Captura, alocação e repasse de operações

Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA, a serem utilizadas nos processos de captura, alocação e repasse de operações.

A implantação da integração das clearings da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
15/12/2014	2.0	Versão Inicial	
31/03/2015	2.1	Alteração na mensagem bvmf.019.02, inclusão do campo Order Identification.	
30/04/2015	2.2	Alteração na mensagem bvmf.018.02, inclusão de Identification (conta), TradeIdentification, AutomatedSessionIndicator, PaymentType, SecurityAccountType, RequestSource e StatusCode e Regras.	
29/05/2015	2.3	Atualização das mensagens bvmf.170.01, bvmf.014.02 e bvmf.019.02 para inclusão do Campo Outros Valores (Other Values – OthrVals), Criação das mensagens bvmf.020.02, bvmf.021.02 e bvmf.022.02; Criação dos arquivos BVBG.013.02, BVBG.014.02 e BVBG.015.02. Inclusão TradeDate na bvmf.018.02.	
15/06/2015	2.4	Criação do BVBG.012.02	
30/06/2015	2.5	Atualização nas mensagens bvmf.019.02 e bvmf.022.02.	
15/07/2015	2.6	Criação da bvmf.186.01, bvmf.187.01 e BVBG.081 Atualização nas mensagens bvmf.017.02, bvmf.018.02.	

Descrição detalhada no documento “Histórico de Alterações”.

Versão de Schema

A versão deste catálogo contempla as versões abaixo dos schemas XSDs.

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
bvmf.012.01	1.8
bvmf.013.01	1.6
bvmf.014.02	2.1
bvmf.015.01	1.6
bvmf.016.01	1.7
bvmf.017.02	2.1
bvmf.018.02	2.2
bvmf.019.02	2.3
bvmf.020.02	2.0
bvmf.021.02	2.0
bvmf.022.02	2.1
bvmf.170.01	1.1
bvmf.186.01	1.0
bvmf.187.01	1.0
SUPL.012.01	1.6
SUPL.017.02	2.1

Descrição detalhada no documento “Manual Técnico”.

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN

Mensagem somente atendem a Clearing de Derivativos (V1 IPN)	Mensagem pode sofrer ajuste para atender Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada (V2 do IPN)	Mensagem revisada para atender V2 do IPN	Novas Mensagens para Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada
	bvmf.012.01 TradeLegNotification	bvmf.014.02 SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice	bvmf.170.01 – ETFTradeNotification
	bvmf.013.01 SecuritiesAllocationInstruction	bvmf.019.02 InformGiveUpPendingApproval	
	bvmf.015.01 SecuritiesAllocationInstructionCancellation	bvmf.017.02 TradeLegNotificationCancellation	
	bvmf.016.01 ResponseGiveUpAcceptanceorRejection	BVBG.038.02 SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice	
	BVBG.012.01 TradeLegNotification	bvmf.018.02 TradeManagementReportRequest	
	BVBG.013.02 SecuritiesAllocationDetails		
	BVBG.014.02 GiveUpTradeDetails		
	BVBG.015.02 TakeUpTradeDetails		
	BVBG.037.01 SecuritiesAllocationInstruction		
	BVBG.039.01 SecuritiesAllocationInstructionCancellation		
	BVBG.040.02 TradeManagementReportRequest		

Conteúdo

Histórico de Revisão 2

Versão de Schema 3

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN 4

Visão geral 16

Escopo *16*

Lista de Mensagens e Arquivos *16*

Conteúdo do Arquivo 20

Como Ler *21*

Fluxo de Mensagens 22

Informa Negócio Realizado *22*

Introdução 22

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Realizado 22

Informa Negócio Cancelado *23*

Introdução 23

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Cancelado 23

Inclusão de Alocação *24*

Introdução 24

Cenário1: Inclusão de Alocação de Negócios com Sucesso 24

Cenário2: Inclusão de Alocação de Negócios com Erro 26

Exclusão de Alocação *27*

Introdução 27
Cenário1: Exclusão de Alocação de Negócios com Sucesso 27
Cenário2: Exclusão de Alocação com Erro 29

Repasse de Operações *30*
Introdução 30
Cenário1: Repasse na Captura do Negócio 30
Cenário2: Repasse na Alocação do Negócio com Sucesso 32
Cenário3: Repasse na Alocação do Negócio com Erro 34

Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Repasse *35*
Introdução 35
Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Repasse 35
Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Cancelamento de Repasse 36

Aceitação ou Rejeição de Repasse *37*
Introdução 37
Cenário1: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito passivamente pelo Participante Destino 37
Cenário2: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Destino– com sucesso 38
Cenário3: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com Erro 40

Fluxo de Mensagens – Quebra de Regras 41

Inclusão de alocação de negócios fora da grade *41*
Introdução 41
Cenário1: Inclusão de Alocação de Negócios fora da grade – aprovada pela Clearing 41
Cenário2: Inclusão de alocação de negócios fora da grade – rejeitada pela Clearing 42

Repasse de Operações solicitados fora da grade *44*
Introdução 44
Cenário1: Repasse solicitado fora da grade 44
Cenário2: Repasse solicitado fora da grade –rejeitado passivamente pelo Participante Destino 46

Cenário3: Repasse solicitado fora da grade – Aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com sucesso 47
Cenário4: Repasse de Operações realizado fora da grade – aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com erro 48

Cancelamento de Repasse solicitado fora da grade (Rejeição de Repasse) *49*
Introdução 49
Cenário1: Cancelamento de repasse solicitado fora da grade – passivamente rejeitado pelo Participante Origem 49
Cenário2: Cancelamento de repasse solicitado fora da grade - aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Origem – com sucesso 50
Cenário3: Cancelamento de repasse de Operações realizado fora da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Origem - com erro 53

Fluxo de Mensagens - ETF 54

Informa Integralização/Resgate de Cotas (ETF) Realizado *54*
Introdução 54
Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio de ETF Realizado no Mercado Primário 54

Informa Integralização/Resgate de Cotas (ETF) Cancelado *55*
Introdução 55

Repasse de Operações de ETF *56*
Introdução 56
Cenário1: Repasse na Captura do Negócio de ETF 56

Atualização de Preço/Ajuste de ETF Realizado no Mercado Primário *58*
Introdução 58
Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Atualização de Preço/Ajuste de ETF Realizado no Mercado Primário – Cenário Sem Repasse 58
Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Atualização de Preço de ETF Realizado no Mercado Primário – Cenário com Repasse 59

Arquivos de consultas de negócios realizados, alocação e repasse de operações 61

Introdução 61
Arquivo “TradeLegNotification” (BVBG.012.01) – Negócios Realizados 61
Cenário1: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados. 61

Cenário2: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados. 62
Cenário3: BM&FBOVESPA informa negócios realizados 63
Cenário4: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados. 63
Cenário 5 Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados. 64
Arquivo “SecuritiesAllocationDetails” (BVBG.013.02) – Negócios Alocados 65
Cenário1: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados. 65
Cenário2: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados. 66
Cenário3: BM&FBOVESPA informa negócios alocados 67
Cenário4: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados. 68
Arquivo “GiveUpTradeDetails” (BVBG.014.02) - Repasses Enviados pelo Participante Origem do repasse 69
Cenário1: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados. 69
Cenário2: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados. 70
Cenário3: BM&FBOVESPA informa repasses enviados pelo Participante 70
Cenário4: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados. 71
Arquivo “TakeUpTradeDetails” (BVBG.015.02) - Repasses Recebidos pelo Participante Destino do repasse 72
Cenário1: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante. 72
Cenário2: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante. 73
Cenário3: BM&FBOVESPA informa repasses recebidos pelo Participante 74
Cenário4: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante. 75
Cenário 1: Participante envia mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) com erro no ExternalReportTypeCode 76

Fluxo de Mensagens - Hash 77

Conciliação da alocação *77*
Introdução 77
Cenário1: Participante solicita informações do hash. 77
Cenário2: Participante solicita informações do hash. 78

Arquivos de Contingência 80

Introdução 80
Inclusão de Alocação ou Repasse por meio de arquivo de contingência (BVBG.037.01) 81
Cenário 1: Inclusão de Alocação ou Repasse de Negócios por meio de arquivo de contingência 81
Exclusão de Alocação por meio de arquivo de contingência (BVBG.039.01) 84
Cenário 1: Exclusão de Alocação de Negócios por meio de arquivo de contingência 84
BM&FBOVESPA informa retorno da solicitação enviada por meio de arquivo de contingência (BVBG.038.02) 85
Cenário 1 : Participante recebe arquivo ""SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice""– em Contingência 85
Solicitação de arquivos de consulta de alocação por meio de arquivo de contingência (BVBG.040.02) 86
Cenário 1: Participante solicita arquivo "TradeLegNotification" (BVBG.012.01)– em Contingência 86
Cenário 2: Participante solicita arquivo "SecuritiesAllocationDetails" (BVBG.013.02) – em Contingência 87
Cenário 3: Participante Origem do repasse solicita arquivo "GiveUpTradeDetails" (BVBG.014.02) – em Contingência 88
Cenário 4: Participante Destino do repasse solicita arquivo "TakeUpTradeDetails" (BVBG.015.02) – em Contingência 88
Cenário 5: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) contendo erro de negócio 89
Cenário 6: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) contendo erro técnico. 90
Cenário 7: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) – com ExternalReportTypeCode errado. 91
Tabela 93

bvmf.012.01 – TradeLegNotification 95

Funcionalidade da Mensagem 95
Escopo 95
Uso 95
Diagrama da Mensagem 95
Diagrama da Mensagem (Supplementary Data) 97
Regras 99
Estrutura 99
bvmf.012.01 – TradeLegNotification 99
Supplementary Data 104
Supplementary Data – bvmf.012.01 – TradeLegNotification 104

bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction 112

Funcionalidade da Mensagem *112*
Escopo 112
Uso 113
Diagrama da Mensagem 114
Regras 116
Estrutura 116
bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction 116

bvmf.014.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice 121

Funcionalidade da Mensagem *121*
Escopo 121
Uso 121
Diagrama da Mensagem 122
Regras 122
Estrutura 123
bvmf.014.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice 123

bvmf.015.01 - SecuritiesAllocationInstructionCancellation 129

Funcionalidade da Mensagem *129*
Escopo 129
Uso 129
Diagrama da Mensagem 130
Regras 131
Estrutura 131
bvmf.015.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation 131

bvmf.016.01 – ResponseGiveUpAcceptanceorRejection 133

Funcionalidade da Mensagem *133*
Escopo 133
Uso 134
Diagrama da Mensagem 135
Regras 137
Estrutura 138
bvmf.016.01 – ResponseGiveUpAcceptanceorRejection 138

bvmf.017.02 – TradeLegNotificationCancellation 143

Funcionalidade da Mensagem *143*
Escopo 143
Uso 143
Diagrama da Mensagem (Supplementary Data) 145
Regras 145
Estrutura 146
bvmf.017.02 – TradeLegNotificationCancellation 146
Supplementary Data - SUPL.017.02 – TradeLegNotificationCancellation 150

bvmf.019.02 – InformGiveUpPendingApproval 153

Funcionalidade da Mensagem *153*
Escopo 153
Uso 153
Diagrama da Mensagem 154
Regras 155
Estrutura 155
bvmf.019.02 – InformGiveUpPendingApproval 155

bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest 168

Funcionalidade da Mensagem *168*
Escopo 168
Uso 168
Diagrama da Mensagem 168
Regras 169
bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest 170

bvmf.170.01 – ETFTradeNotification 176

Funcionalidade *176*
Escopo 176
Uso 176
Diagrama da Mensagem 178
Regras 179
bvmf.170.01 – ETFTradeNotification 179

BVBG.012.01 – TradeLegNotification 189

Funcionalidade *189*
Escopo 189
Uso 189
Diagrama da Mensagem 189
Regras 190
Estrutura da mensagem ”TradeLegNotification” (bvmf.012.01) 190
Estrutura da mensagem ”ETFTradeNotification” (bvmf.170.01) 190

BVBG.013.02 – SecuritiesAllocationDetails 190

Funcionalidade *191*
Escopo 191
Uso 191

Diagrama da Mensagem 191
Regras 192
Estrutura da mensagem ”SecuritiesAllocationDetails” (bvmf.020.02) 193

BVBG.014.02 – GiveUpTradeDetails 211

Funcionalidade *211*
Escopo 211
Uso 211
Diagrama da Mensagem 211
Regras 212
Estrutura da mensagem “GiveUpTradeDetails” (bvmf.021.02) 213

BVBG.015.02 – TakeUpTradeDetails 228

Funcionalidade *228*
Escopo 228
Uso 229
Diagrama da Mensagem 229
Regras 230
Estrutura da mensagem “TakeUpTradeDetails “(bvmf.022.02) 230

BVBG.037.01 – SecuritiesAllocationInstruction 244

Funcionalidade *244*
Escopo 244
Uso 245
Diagrama da Mensagem 245
Regras 247
Estrutura da mensagem” SecuritiesAllocationInstruction” (bvmf.013.01) 247
bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction 247

BVBG.038.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice 252

Funcionalidade *252*
Escopo 252
Uso 252
Diagrama da Mensagem 252
Regras 254
Estrutura da mensagem" SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice" (bvmf.014.01) 254
bvmf.014.01 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice 254

BVBG.039.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation 260

Funcionalidade *260*
Escopo 260
Uso 260
Diagrama da Mensagem 261
Regras 263
Estrutura da mensagem" SecuritiesAllocationInstructionCancellation" (bvmf.015.01) 263
bvmf.015.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation 263

BVBG.040.02 – TradeManagementReportRequest 266

Funcionalidade *266*
Escopo 266
Uso 266
Diagrama da Mensagem 267
Regras 268
Estrutura da mensagem" TradeManagementReportRequest" (bvmf.018.02) 269
bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest 269

bvmf.186.01 – AllocationHashRequest 277

Funcionalidade *277*
Escopo 277
Uso 277
Diagrama da Mensagem 278
Regras 278
Estrutura da mensagem" AllocationHashRequest" (bvmf.186.01) 278

BVBG.081.01 – AllocationHashResponse 280

Funcionalidade *280*
Escopo 280
Uso 281
Diagrama da Mensagem 281
Regras 281
Estrutura da mensagem" AllocationHashResponse" (bvmf.187.01) 281

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA para os fluxos de captura, alocação e repasse de operações.

Os cenários de negócios foram modelados e uma série de mensagens XML foi concebida. No devido tempo, essas mensagens serão submetidas à ISO20022, órgão de registro, para aprovação. Cada cenário de negócio é representado por um fluxo de trabalho padronizado e um número fixo de mensagens normatizadas.

Lista de Mensagens e Arquivos

1. TradeLegNotification <bvmf.012.01>

A mensagem TradeLegNotification é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno executor do negócio no sistema de negociação, e detalha informações dos negócios capturados.

2. SecuritiesAllocationInstruction < bvmf.013.01>

A mensagem SecuritiesAllocationInstruction é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de informações de alocação (identificação de conta de comitente final, indicação de conta máster e demais informações necessárias para fins de liquidação) e repasse de negócio.

3. SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <bvmf.014.01>

A mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informando a situação da solicitação de alocação (inclusão ou exclusão), situação do repasse realizado e/ou atualização de preço/ajuste de ETF Primário (quando houver repasse).

4. SecuritiesAllocationInstructionCancellation <bvmf.015.01>

A mensagem SecuritiesAllocationInstructionCancellation é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA como requisição para exclusão de alocação.

5. ResponseGiveUpAcceptanceorRejection <bvmf.016.01>

A mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para informar a aceitação ou rejeição do repasse ou do cancelamento de repasse.

6. TradeLegNotificationCancellation <bvmf.017.02>

A mensagem TradeLegNotificationCancellation é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação e informa negócio cancelado no sistema de negociação ou cancelamento de operação de Integralização/Resgate de cotas realizada.Todos os participantes envolvidos (comprador e vendedor), e participantes envolvidos em caso de repasse, recebem esta mensagem.

7. InformGiveUpPendingApproval <bvmf.019.02>

A mensagem InformGiveUpPendingApproval é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com o objetivo de informar um negócio pendente de aceitação ou rejeição de repasse ou cancelamento de repasse.

8. TradeManagementReportRequest <bvmf.018.02>

A mensagem TradeManagementReportRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia para a BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar uma consulta de negócios alocados, negócios realizados, repasses recebidos ou repasses enviados.

9. ETFTradeNotification < bvmf.170.01>

A mensagem ETFTradeNotification é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno para informar a realização de operação de Integralização/Resgate de cotas realizada no sistema primário de negociação e atualização de preço/ajuste deste negócio.

11. TradeLegNotification <BVBG.012.01>

O arquivo TradeLegNotification é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno e detalha informações dos negócios realizados na data corrente.

12. SecuritiesAllocationDetails <BVBG.013.02>

O arquivo SecuritiesAllocationDetails é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia e detalha informações dos negócios alocados.

13. GiveUpTradeDetails<BVBG.014.02>

O arquivo GiveUpTradeDetails é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno atuando como Participante Origem do repasse, e detalha informações dos repasses enviados.

14. TakeUpTradeDetails<BVBG.015.02>

O arquivo TakeUpTradeDetails é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação atuando como Participante Destino do repasse, e detalha informações dos repasses recebidos.

15. SecuritiesAllocationInstruction <BVBG.037.01>

O arquivo SecuritiesAllocationInstruction é enviado pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de alocação (identificação de conta de comitente final, indicação de conta máster e demais informações necessárias para fins de liquidação) e repasse de negócios. Este arquivo é utilizado em contingência.

16. SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <BVBG.038.02>

O arquivo SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação e pode informar a situação das solicitações de alocação (inclusão ou exclusão) ou situação dos repasses realizados, erro de negócio e erro técnico na solicitação de um arquivo. Este arquivo é utilizado em contingência.

17. SecuritiesAllocationInstructionCancellation <BVBG.039.01>

O arquivo SecuritiesAllocationInstructionCancellation é enviado pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar a exclusão de alocações. Este arquivo é utilizado em contingência.

18. TradeManagementReportRequest <BVBG.040.02>

O arquivo TradeManagementReportRequest é enviado pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia para a BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar uma consulta de negócios alocados, negócios realizados, repasses recebidos ou repasses enviados. Este arquivo é utilizado em contingência.

19. AllocationHASHRequest <bvmf.186.01>

A mensagem AllocationHASHRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno e pelo Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar uma conciliação da alocação realizada até o momento.

20. AllocationHASHResponse <BVBG.081.01>

O arquivo AllocationHASHResponse é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação contendo informações do hash.

Conteúdo do Arquivo

Sigla do Arquivo	Nome do Arquivo	Conteúdo do Arquivo
BVBG.012.02	Trade Leg Notification	bvmf.012.01 bvmf.170.01
BVBG.013.02	Securities Allocation Details	bvmf.020.02
BVBG.014.02	Give Up Trade Details	bvmf.021.02
BVBG.015.02	Take Up Trade Details	bvmf.022.02
BVBG.037.01	SecuritiesAllocationInstruction	bvmf.013.01
BVBG.038.02	SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice	bvmf.014.02 tsmt.016.001.03 admi.002.001.01
BVBG.039.01	SecuritiesAllocationInstructionCancellation	bvmf.015.01
BVBG.040.02	TradeManagementReportRequest	bvmf.018.02
BVBG.081.01	AllocationHASHResponse	bvmf.187.01

Como Ler

UML (Unified Modeling Language) tem sido usada para descrever modelos lógicos e de negócios. Como o entendimento de UML não é um requisito para a discussão de padrões de negócios, o formato de dados para as mensagens é apresentado de uma forma mais amigável. Esta forma de representação é gerada automaticamente a partir dos modelos, garantindo assim, a coerência absoluta entre as informações do modelo e a norma publicada.

Fluxo de Mensagens

Informa Negócio Realizado

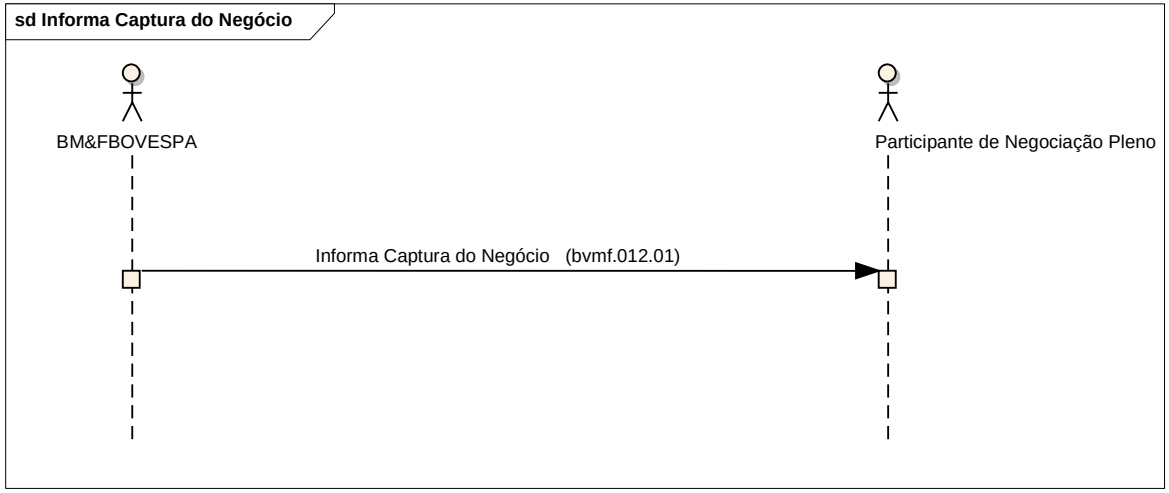
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem TradeLegNotification em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar negócio realizado no sistema de negociação.

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Realizado

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a captura de um negócio.

- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem TradeLegNotification (bvmf.012.01) ao Participante de Negociação Pleno executor do negócio informando a captura do negócio realizado, e seu detalhamento.



Informa Negócio Cancelado

Introdução

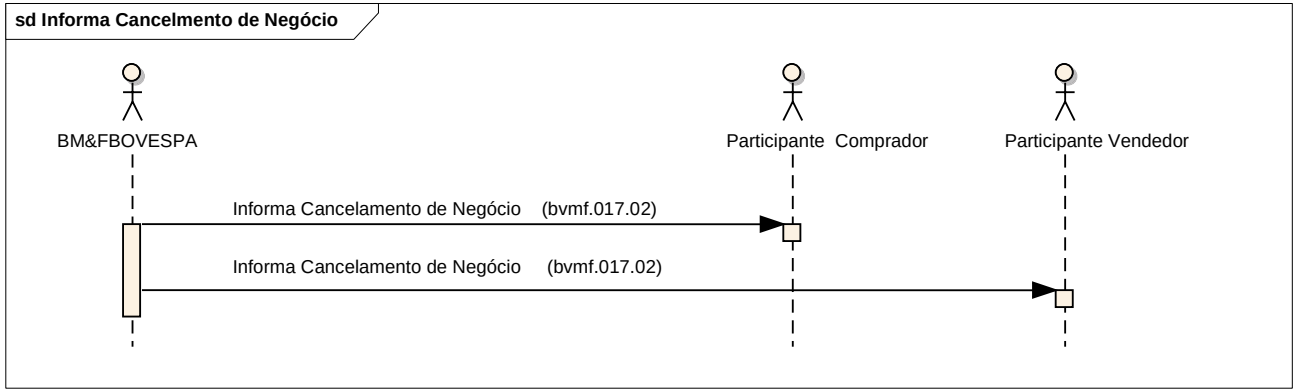
Este fluxo ilustra o uso da mensagem TradeLegNotificationCancellation em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar o cancelamento do negócio.

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Cancelado

Este cenário é básico e o mais elementar para informar o cancelamento do negócio.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem TradeLegNotificationCancellation (bvmf.017.02) informando o cancelamento do negócio ao Participante de Negociação Pleno (comprador e vendedor).

-Caso o negócio tenha sido repassado, o Participante Origem e Destino do repasse também receberá a mensagem TradeLegNotificationCancellation (bvmf.017.02).



Inclusão de Alocação

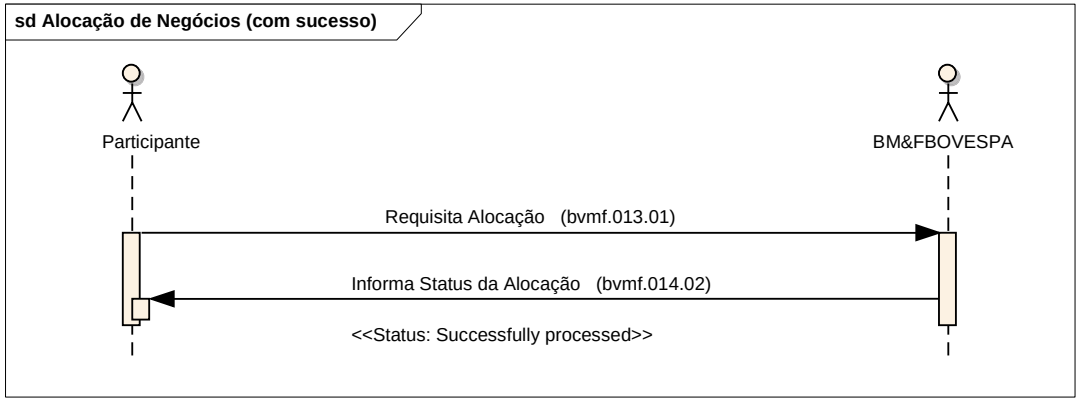
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesAllocationInstruction em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar alocação realizada com sucesso ou alocação com erro.

Cenário1: Inclusão de Alocação de Negócios com Sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para alocação de um negócio.

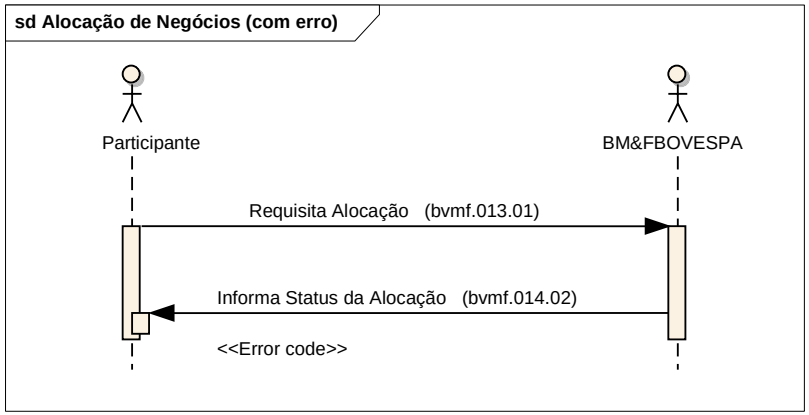
- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão da alocação do negócio e informa todos os detalhes pertinentes à alocação;
- O intuito desse fluxo é representar uma alocação simples, sem o objetivo de realizar o repasse da operação, ou seja, a conta informada não possui um vínculo de repasse previamente cadastrado na BM&FBOVESPA, e a alocação encontra-se dentro da grade horária.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02)informando ao Participante a situação da alocação solicitada (processada com sucesso).


sd Alocação de Negócios (com sucesso)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação (bvmf.013.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
<<Status: Successfully processed>>

Cenário2: Inclusão de Alocação de Negócios com Erro

Este cenário é de uma solicitação de alocação com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de alocação e informa os detalhes da alocação com alguma não-conformidade.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante a situação de rejeição da alocação e seu respectivo código de erro.
- O Participante verifica a mensagem de erro e pode enviar uma nova mensagem de requisição de alocação.



Exclusão de Alocação

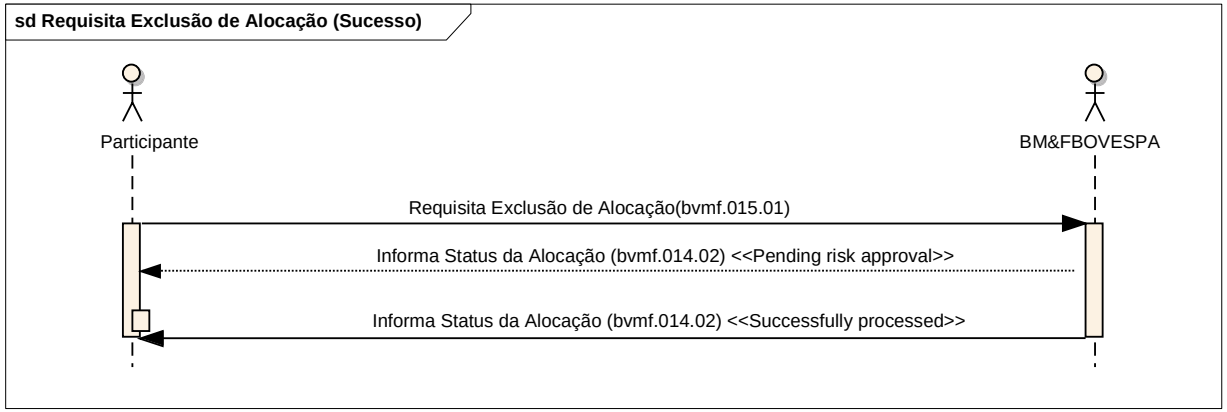
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesAllocationInstructionCancellation em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar exclusão de alocação realizada com sucesso ou exclusão de alocação com erro.

Cenário1: Exclusão de Alocação de Negócios com Sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para exclusão da alocação de um negócio.

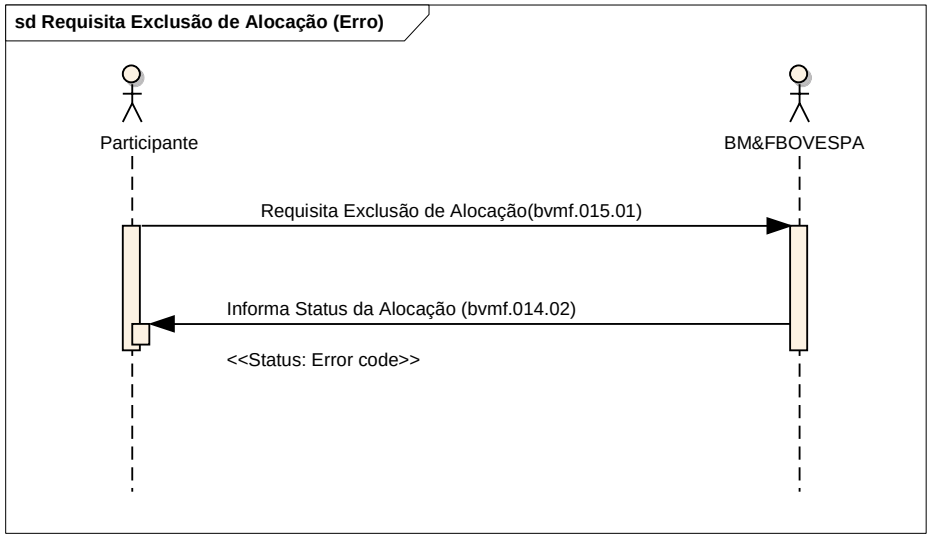
- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesAllocationInstructionCancellation (bvmf.015.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a exclusão da alocação do negócio;
- A solicitação de exclusão de alocação é enviada para análise de risco na BM&FBOVESPA, que poderá automaticamente aprová-la ou mantê-la pendente (por exemplo, aguardando depósito de colaterais). Neste último caso, o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação receberá a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando a situação de exclusão de alocação (pendente de análise de risco).
-Após regularização da situação de pendência, a BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante a situação da exclusão da alocação (processada com sucesso).


sd Requisita Exclusão de Alocação (Sucesso)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita Exclusão de Alocação(bvmf.015.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02) <<Pending risk approval>>
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02) <<Successfully processed>>

Cenário2: Exclusão de Alocação com Erro

Este cenário é de uma solicitação de exclusão de alocação com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesAllocationInstructionCancellation (bvmf.015.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a exclusão da alocação do negócio com alguma não-conformidade;
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante a situação de rejeição da exclusão de alocação e seu respectivo código do erro.



Repasse de Operações

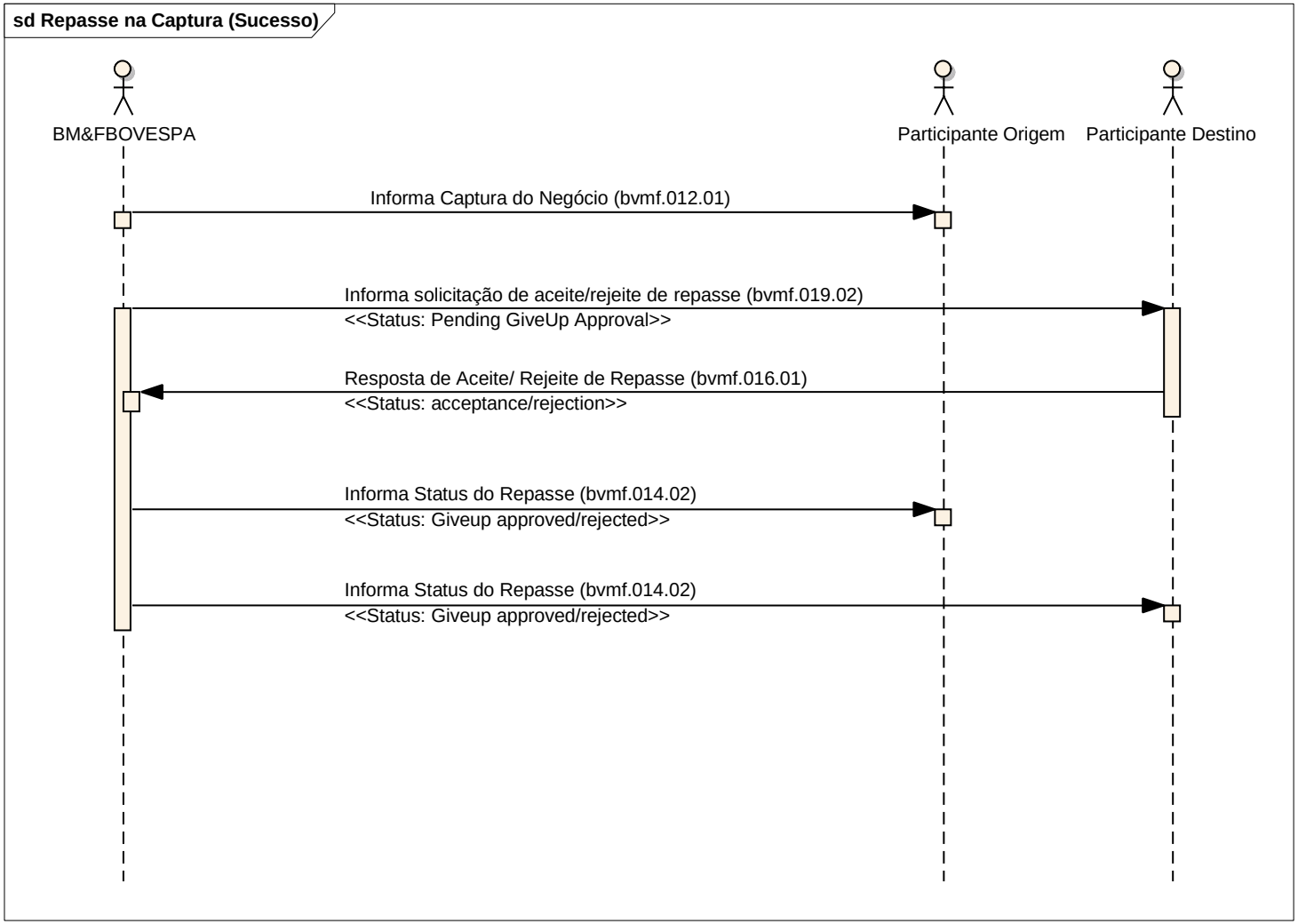
Introdução

Esta seção ilustra fluxos de repasse de operações em típicos cenários sequenciais para informar repasse realizado com sucesso ou erro. O repasse pode ocorrer na captura do negócio realizado (caso a conta capturada na ordem possua vínculo de repasse) ou na inclusão de alocação (caso a conta alocada possua vínculo de repasse).

Cenário1: Repasse na Captura do Negócio

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a captura de um negócio com repasse.

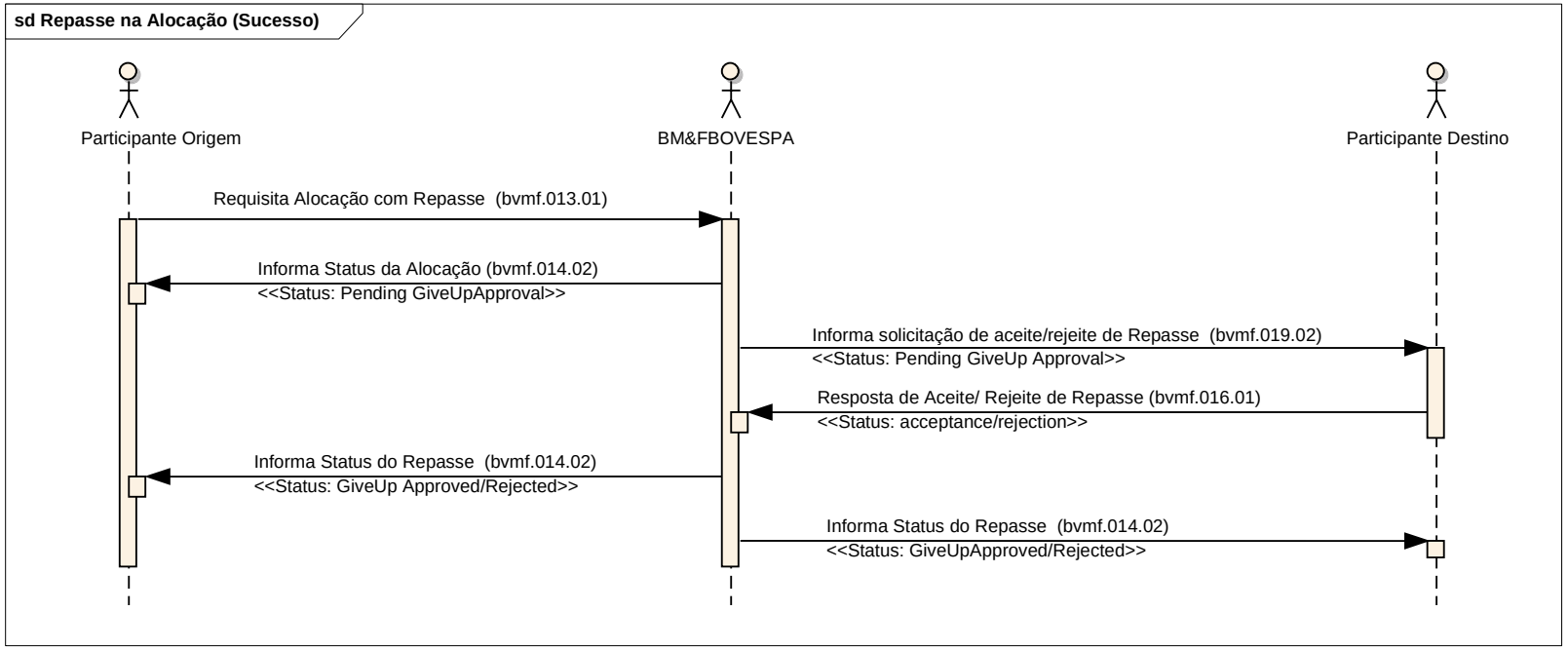
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem TradeLegNotification (bvmf.012.01) ao Participante Origem informando a captura do negócio realizado e seu detalhamento. Esta mensagem possui atributos que permitem identificar que o negócio foi repassado para um Participante Destino.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino pode enviar a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) aceitando ou rejeitando o repasse de negócio.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (repasse aprovado ou rejeitado).


sd Repasse na Captura (Sucesso)
BM&FBOVESPA
Participante Origem
Participante Destino
Informa Captura do Negócio (bvmf.012.01)
Informa solicitação de aceite/rejeite de repasse (bvmf.019.02)
<<Status: Pending GiveUp Approval>>
Resposta de Aceite/ Rejeite de Repasse (bvmf.016.01)
<<Status: acceptance/rejection>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: Giveup approved/rejected>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: Giveup approved/rejected>>

Cenário2: Repasse na Alocação do Negócio com Sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para repasse de negócio.

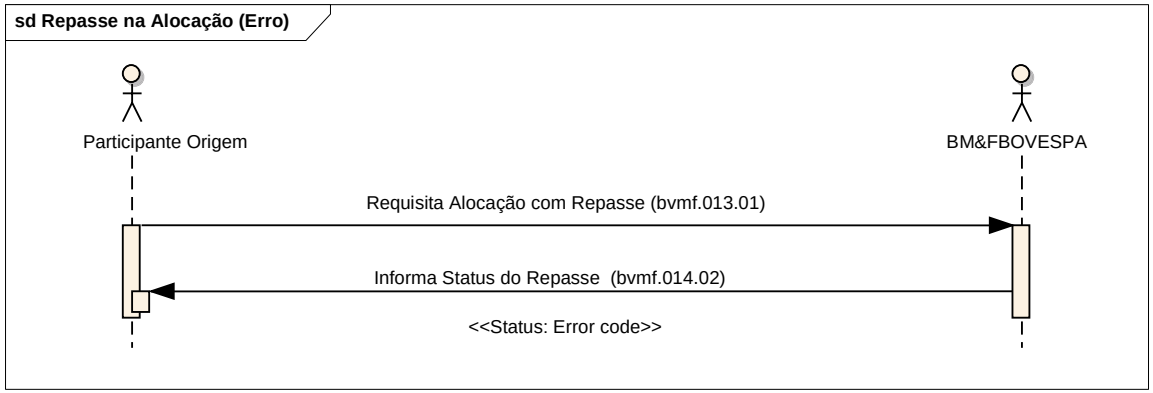
- O Participante Origem envia a mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de alocação de uma conta cadastrada com vínculo de repasse para uma conta no Participante Destino.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante Origem a situação da alocação (pendente de aprovação/rejeição de repasse).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino pode enviar a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) aceitando ou rejeitando o repasse de negócio.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (aprovado ou rejeitado).


sd Repasse na Alocação (Sucesso)
Participante Origem
BM&FBOVESPA
Participante Destino
Requisita Alocação com Repasse (bvmf.013.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
<<Status: Pending GiveUpApproval>>
Informa solicitação de aceite/rejeite de Repasse (bvmf.019.02)
<<Status: Pending GiveUp Approval>>
Resposta de Aceite/ Rejeite de Repasse (bvmf.016.01)
<<Status: acceptance/rejection>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: GiveUp Approved/Rejected>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: GiveUpApproved/Rejected>>

Cenário3: Repasse na Alocação do Negócio com Erro

Este cenário é de uma solicitação de repasse com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- O Participante Origem envia a mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de alocação de uma conta cadastrada com vínculo de repasse de negócio para o Participante Destino.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem a situação da alocação (tentativa de repasse com falha) e seu respectivo código de erro.



Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Repasse

Introdução

Esta seção ilustra o fluxo de mensagem de uma operação pendente de aprovação ou rejeição de repasse ou cancelamento de repasse. Esta mensagem pode ter como destinatário:

- o Participante Destino, informando a existência de uma operação pendente de aprovação de repasse (repasse realizado dentro ou fora da grade), ou

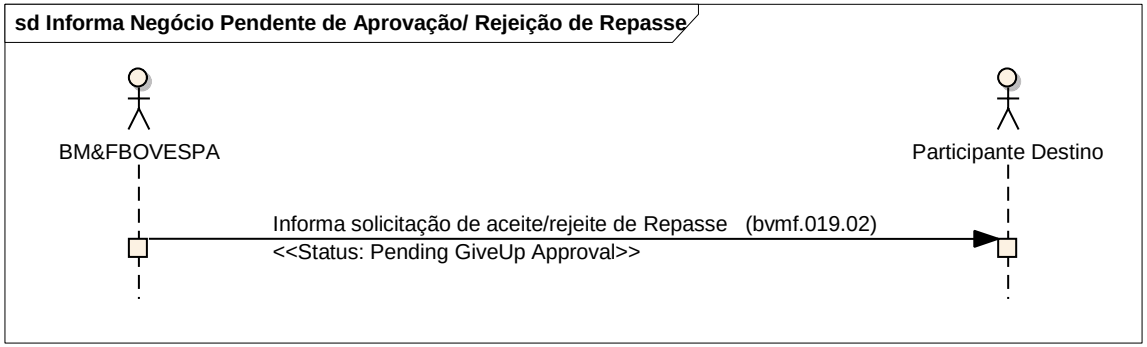
- o Participante Origem, informando a existência de uma operação pendente de aprovação de cancelamento de repasse (rejeição do repasse foi solicitada fora de grade).

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Repasse

Este cenário é básico e o mais elementar para informar um negócio pendente de aprovação/rejeição de repasse pelo Participante Destino.

O fluxo é iniciado através do repasse de uma operação realizada pelo Participante Origem, realizado dentro ou fora da grade.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de uma operação com pendência de aceitação/rejeição de repasse. Caso o repasse tenha sido realizado fora da grade, esta mensagem apresentará os atributos necessários para identificar que o repasse foi realizado fora de horário (Indicativo de fora de horário e faltante responsável pelo atraso).

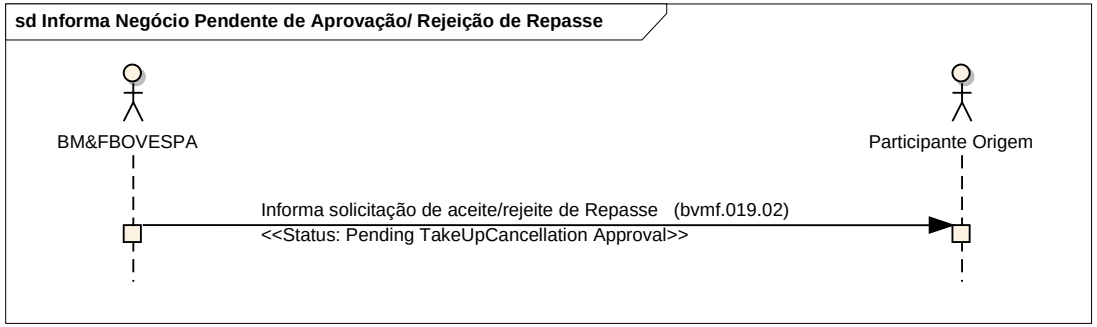


Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Negócio Pendente de Aprovação/Rejeição de Cancelamento de Repasse

Este cenário é básico e o mais elementar para informar um cancelamento de repasse pendente de aprovação/rejeição pelo Participante Origem.

O fluxo é iniciado através do cancelamento de repasse realizado pelo Participante Destino fora do horário limite para rejeição de repasse.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Origem informando a existência de uma operação com pendência de aceitação/rejeição de cancelamento de repasse.
Esta mensagem apresentará os atributos necessários para identificar que o repasse foi realizado fora de horário (Indicativo de fora de horário, faltante responsável pelo atraso)



Aceitação ou Rejeição de Repasse

Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar aceitação ou rejeição de repasse ou cancelamento de repasse de operações. Esta mensagem pode ter como remetente:

- o Participante Destino, informando a aprovação ou rejeição de repasse solicitado pelo Participante Origem (dentro ou fora da grade), ou

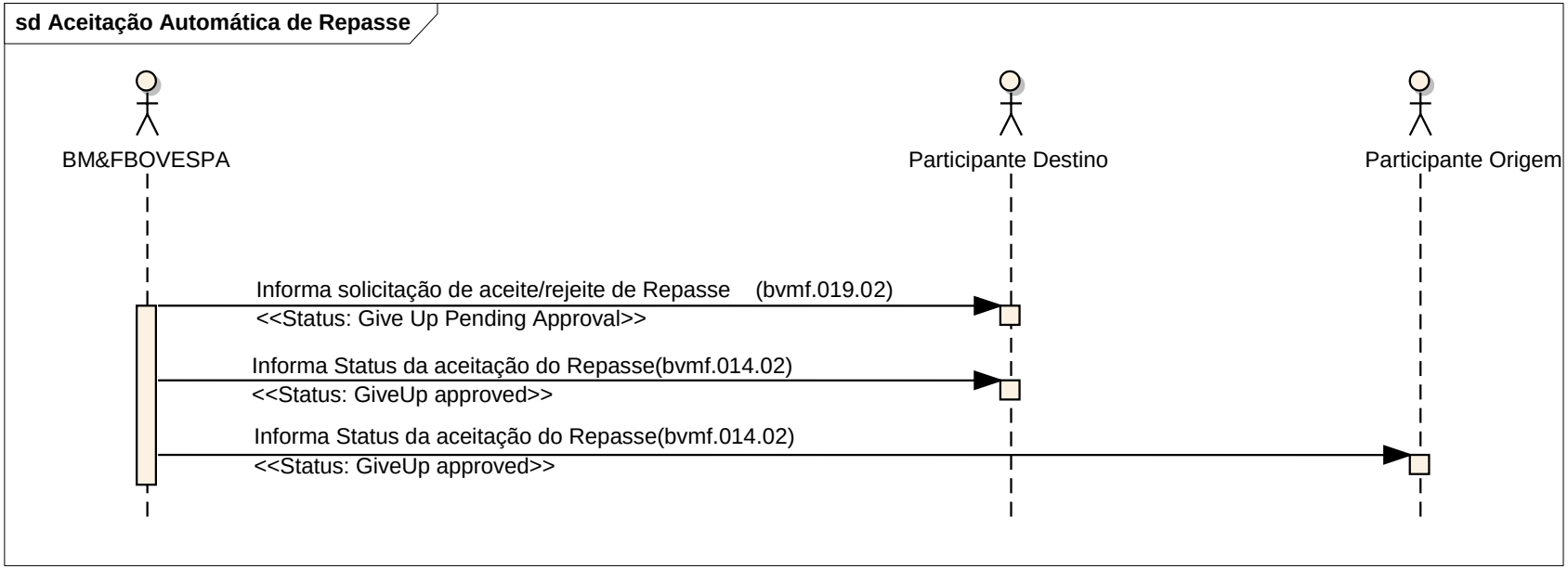
- o Participante Origem, informando a aprovação ou rejeição de cancelamento de repasse solicitado pelo Participante Destino (fora da grade).

Os cenários a seguir representam apenas situações de aceitação ou rejeição de repasse solicitado dentro da grade. Os demais cenários de repasse ou cancelamento de repasse realizados fora do horário serão abordados na seção Quebra de Regras.

Cenário1: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito passivamente pelo Participante Destino

Este cenário é básico e o mais elementar para aceitação automática de repasse.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócio advindo de repasse com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino não toma nenhuma ação e o prazo de Aceitação/Rejeição de repasse é expirado.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (aceito).

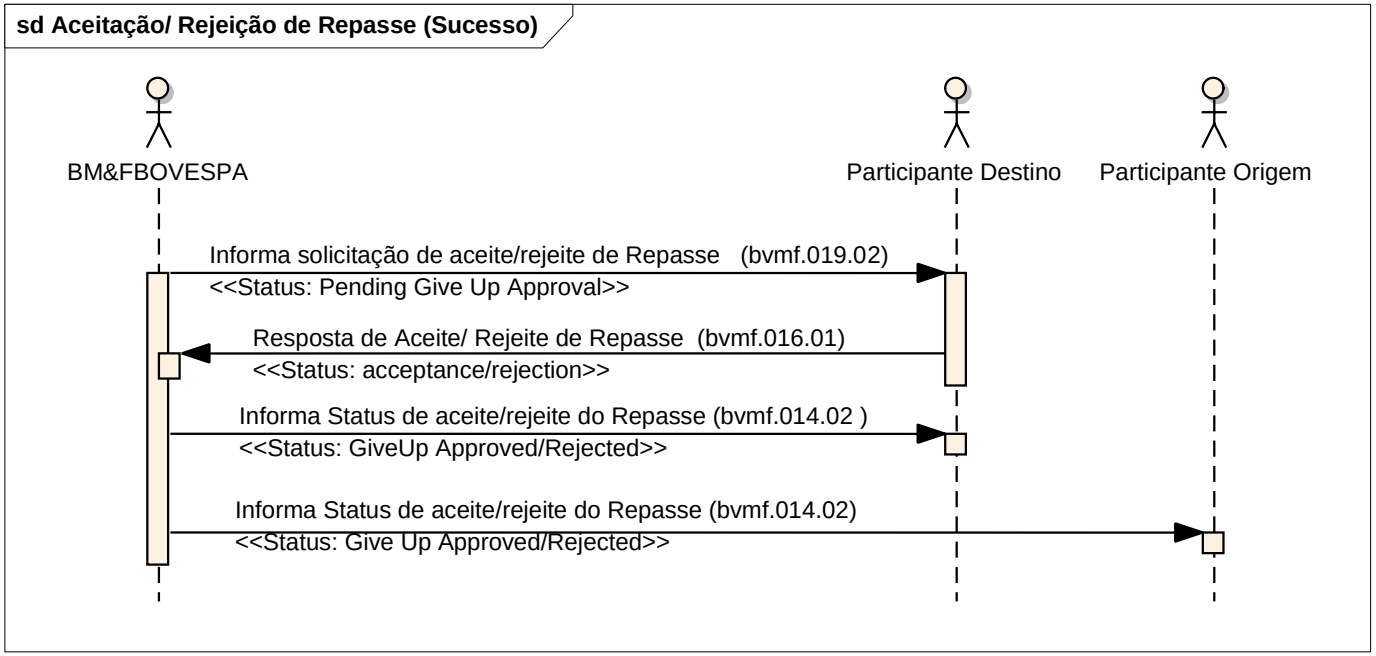


Cenário2: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Destino– com sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para aceitação ou rejeição de repasse realizado dentro do horário limite.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócio advindo de repasse com pendência de aceitação/rejeição.

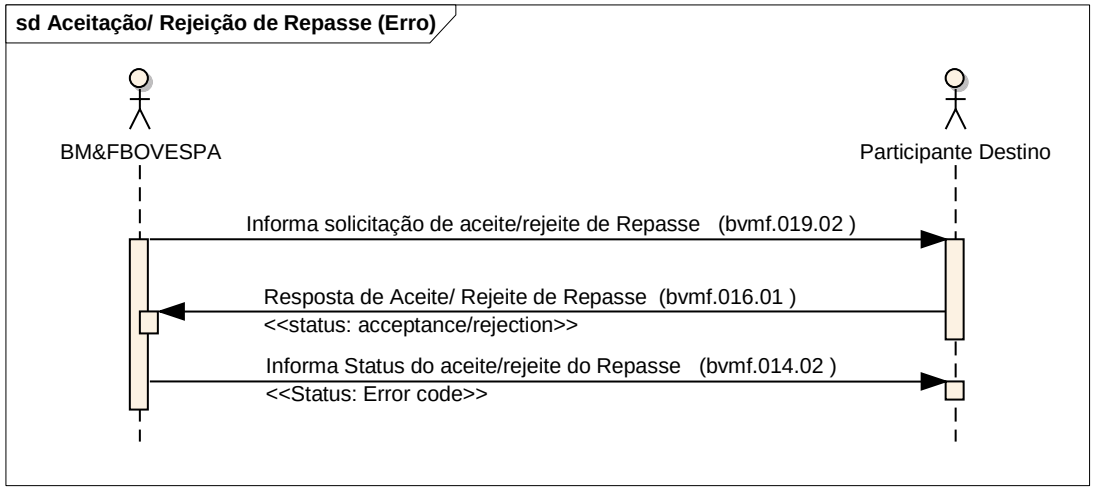
- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a aceitação ou com a rejeição do repasse do negócio.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (aceito ou rejeitado).



Cenário3: Repasse de Operações realizado dentro da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com Erro

Este cenário é de uma solicitação de aceitação ou rejeição de repasse com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse com pendência de aceitação/rejeição;
- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a aceitação ou com a rejeição do repasse do negócio com alguma não-conformidade;
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) respondendo ao Participante Destino a situação de rejeição da solicitação e seu respectivo código do erro.



Fluxo de Mensagens – Quebra de Regras

Inclusão de alocação de negócios fora da grade

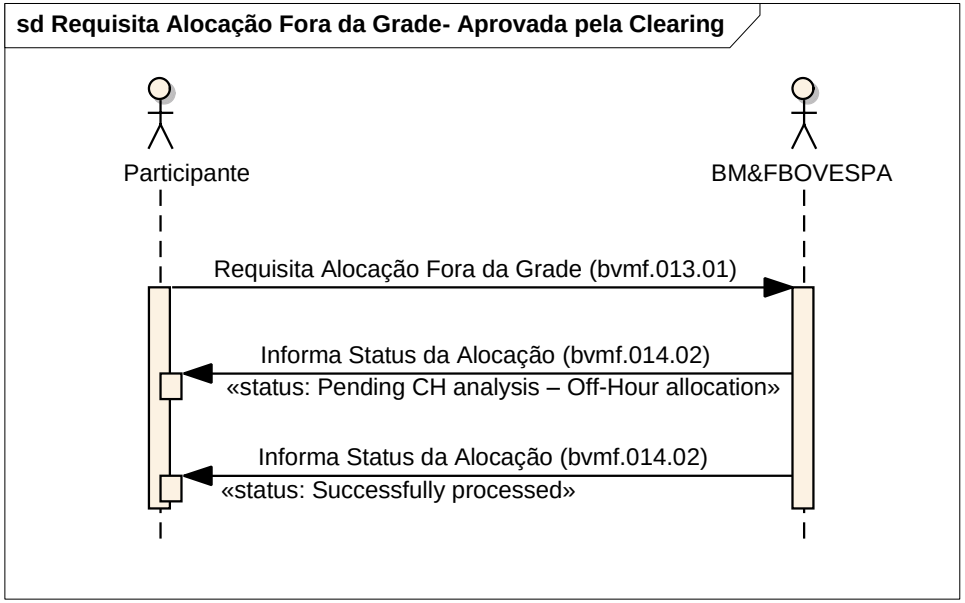
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesAllocationInstruction em típicos cenários sequenciais referentes à inclusão de alocação solicitada fora da grade horária.

Cenário1: Inclusão de Alocação de Negócios fora da grade – aprovada pela Clearing

Este cenário é básico e o mais elementar para a solicitação de inclusão de alocação fora da grade.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão da alocação de uma conta sem vínculo de repasse fora da grade estabelecida. Nesta mensagem, devem ser informados, obrigatoriamente, todos os detalhes pertinentes à alocação fora da grade (campo indicativo de solicitação quebra-regra e justificativa).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02)informando ao Participante a situação da alocação solicitada (Pendente de análise da Clearing – alocação fora da grade).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante a situação da alocação solicitada (Processada com Sucesso).

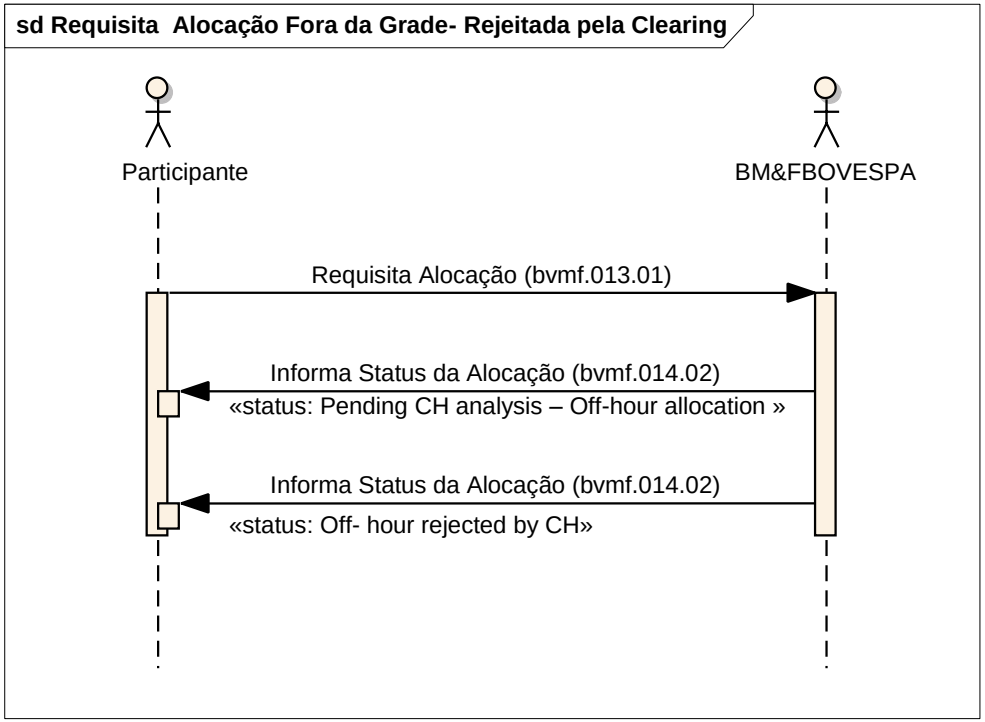

sd Requisita Alocação Fora da Grade- Aprovada pela Clearing
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação Fora da Grade (bvmf.013.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
«status: Pending CH analysis – Off-Hour allocation»
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
«status: Successfully processed»

Cenário2: Inclusão de alocação de negócios fora da grade – rejeitada pela Clearing

Este cenário é básico e o mais elementar para a solicitação de inclusão de alocação fora da grade.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão da alocação de uma conta sem vínculo de repasse fora da grade estabelecida. Nesta mensagem, devem ser informados, obrigatoriamente, todos os detalhes pertinentes à alocação fora da grade (campo indicativo de solicitação quebra-regra e justificativa).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante a situação da alocação solicitada (Pendente de análise da Clearing – Alocação Fora da Grade).

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante a situação da alocação solicitada (Alocação fora de horário rejeitada pela Clearing).

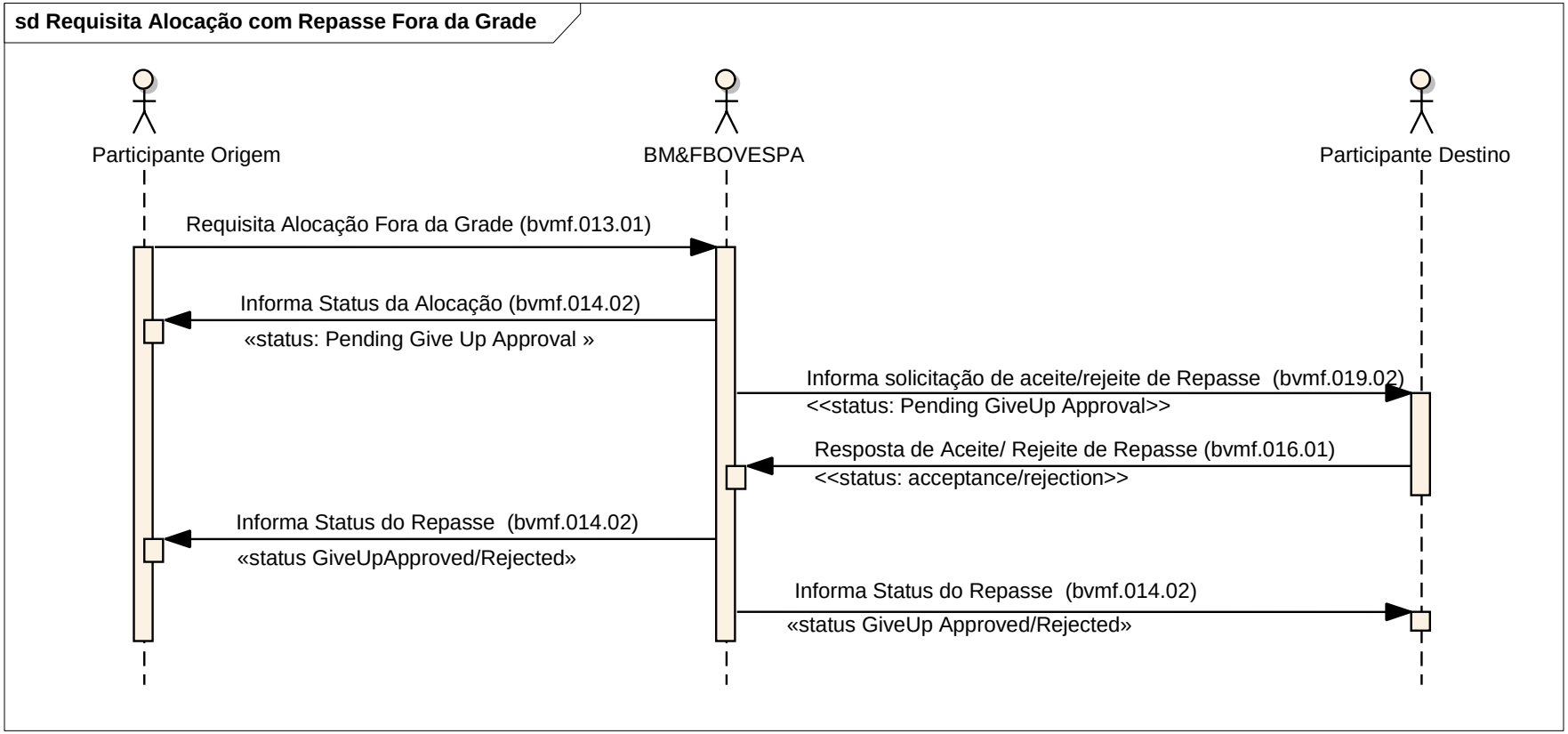

sd Requisita Alocação Fora da Grade- Rejeitada pela Clearing
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação (bvmf.013.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
«status: Pending CH analysis – Off-hour allocation »
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
«status: Off- hour rejected by CH»

Repasse de Operações solicitados fora da grade

Introdução

Cenário1: Repasse solicitado fora da grade

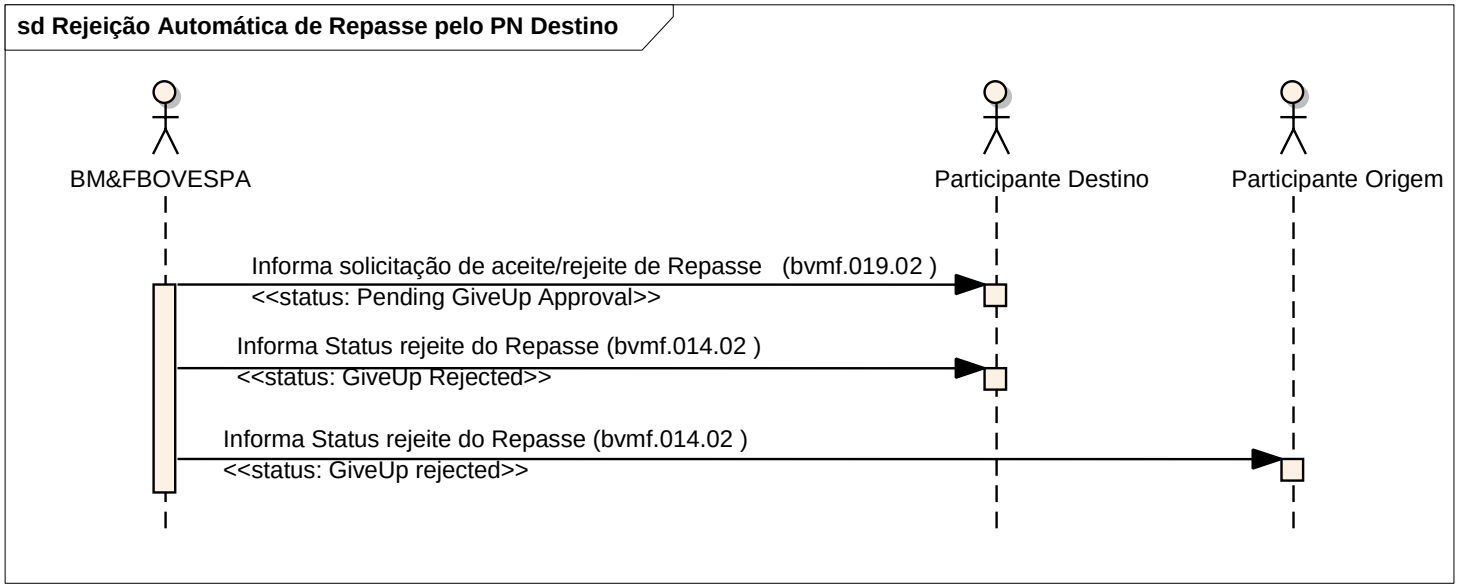
- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01) à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão da alocação fora da grade, para uma conta com vínculo de repasse. Nesta mensagem, devem ser informados, obrigatoriamente, todos os detalhes pertinentes à alocação fora da grade (campo indicativo de quebra-regra, faltante responsável pelo atraso e justificativa).
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem a situação da alocação (pendente de aprovação/rejeição do Participante Destino).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse (e atributo indicativo de solicitação quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso), com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino pode enviar a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) aceitando ou rejeitando o repasse de negócio.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (aprovado ou rejeitado).


sd Requisita Alocação com Repasse Fora da Grade
Participante Origem
BM&FBOVESPA
Participante Destino
Requisita Alocação Fora da Grade (bvmf.013.01)
Informa Status da Alocação (bvmf.014.02)
«status: Pending Give Up Approval »
Informa solicitação de aceite/rejeite de Repasse (bvmf.019.02)
<<status: Pending GiveUp Approval>>
Resposta de Aceite/ Rejeite de Repasse (bvmf.016.01)
<<status: acceptance/rejection>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
«status GiveUpApproved/Rejected»
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
«status GiveUp Approved/Rejected»

Cenário2: Repasse solicitado fora da grade –rejeitado passivamente pelo Participante Destino

Este cenário é básico e o mais elementar para rejeição automática de repasse pelo Participante Destino.

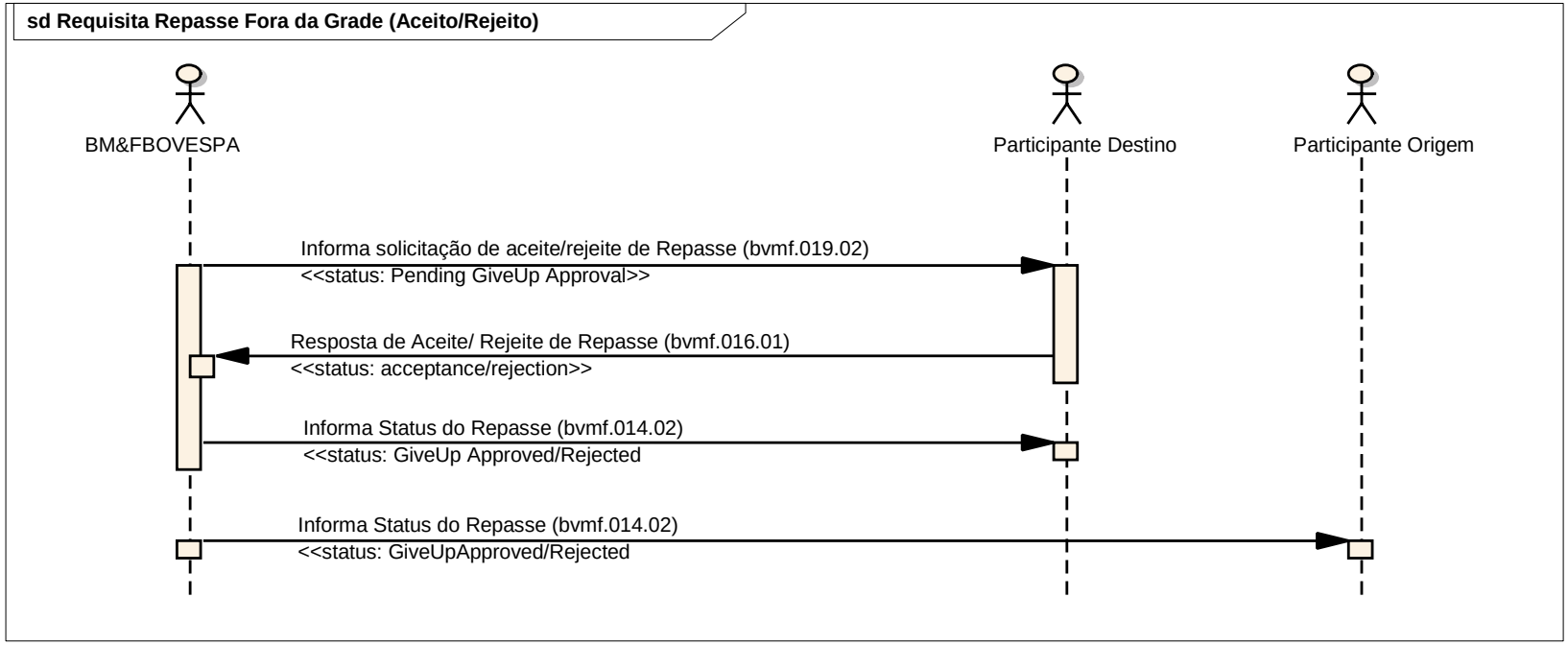
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse (e atributo indicativo de quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso), com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino não toma nenhuma ação e o prazo de aceitação/rejeição de repasse é expirado.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (rejeitado).



Cenário3: Repasse solicitado fora da grade – Aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para aceitação ou rejeição de repasse enviado fora da grade.

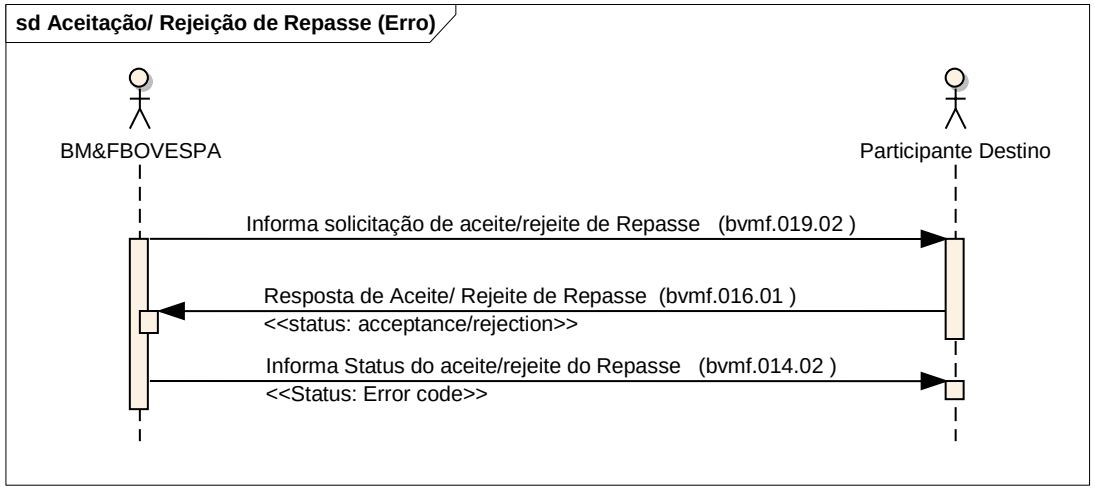
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse (e atributo indicativo de quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso), com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a aceitação ou rejeição do repasse do negócio
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (aceito ou rejeitado).



Cenário4: Repasse de Operações realizado fora da grade – aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Destino - com erro

Este cenário é de uma solicitação de aceitação ou rejeição de repasse com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse com pendência de aceitação/rejeição;
- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a aceitação ou com a rejeição do repasse do negócio com alguma não-conformidade;
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) respondendo ao Participante Destino a situação de erro informando seu respectivo código.



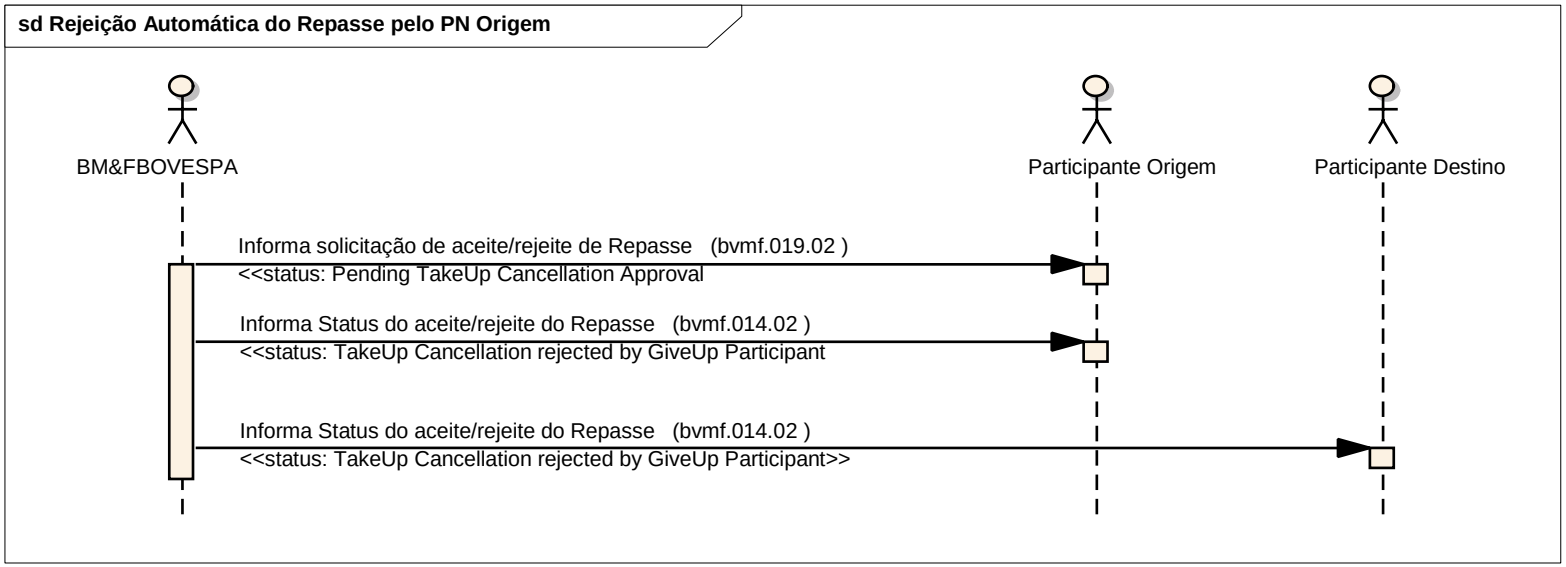
Cancelamento de Repasse solicitado fora da grade (Rejeição de Repasse)

Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection em típicos cenários sequenciais entre duas partes para solicitar um cancelamento de repasse fora da grade horária.

Cenário1: Cancelamento de repasse solicitado fora da grade – passivamente rejeitado pelo Participante Origem

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Origem informando a existência de cancelamento de repasse com pendência de aceitação/rejeição. Nesta mensagem serão informados o atributo indicativo de quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso.
- O Participante Origem não toma nenhuma ação e o prazo de Aceitação/Rejeição de repasse é expirado.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando o Participante Origem e Participante Destino a situação de cancelamento de repasse rejeitado pelo Participante Origem (TakeUp Cancellation Rejected by GiveUp Participant).



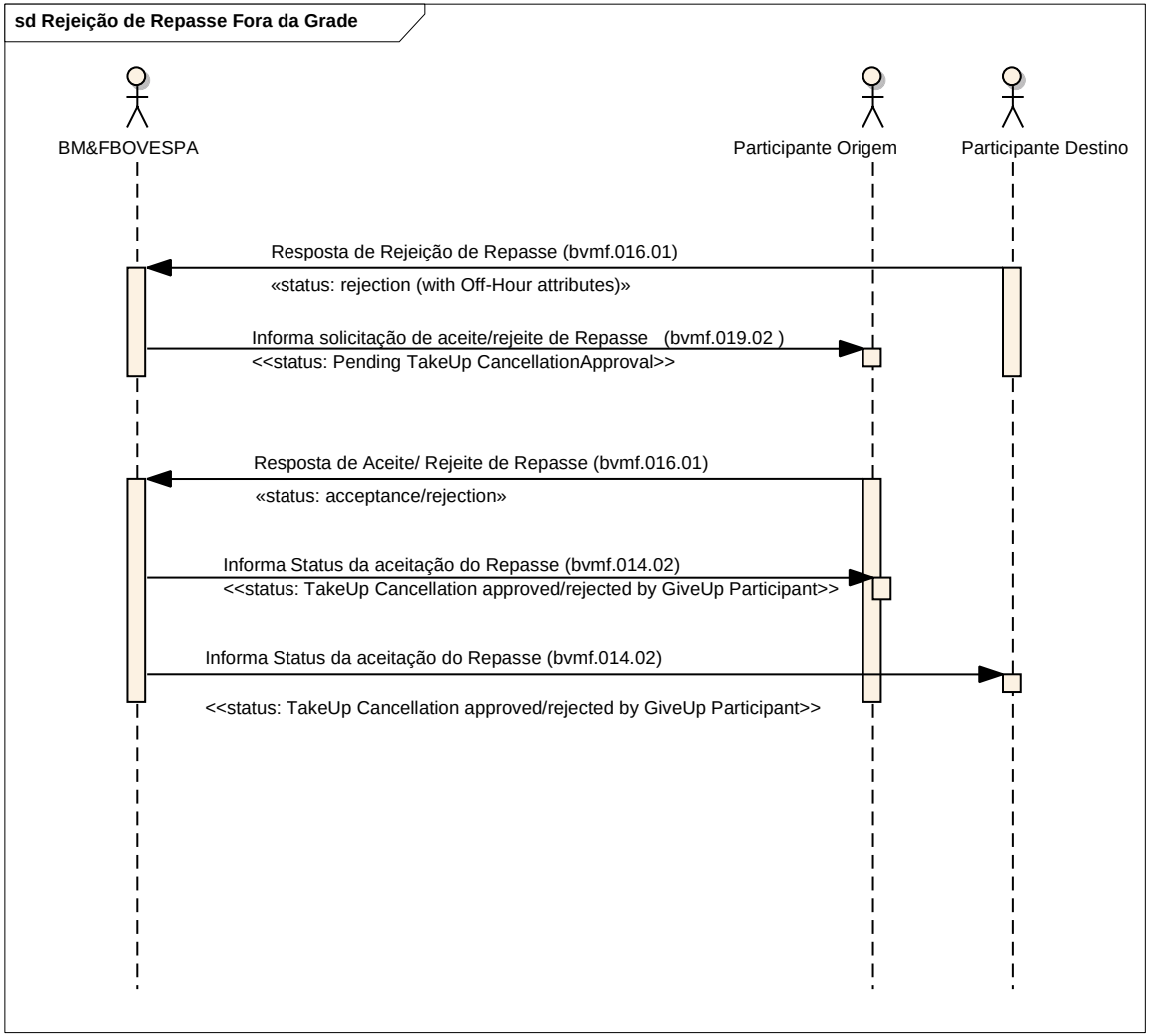
Cenário2: Cancelamento de repasse solicitado fora da grade - aceito ou rejeitado ativamente pelo Participante Origem – com sucesso

Este cenário é básico e o mais elementar para ilustrar a aceitação ou rejeição de cancelamento de repasse solicitado fora da grade.

O fluxo é iniciado com um repasse aprovado no Participante Destino.

- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a solicitação de rejeição do repasse fora da grade. Nesta mensagem, devem ser informados, obrigatoriamente, os atributos relativos à solicitação fora da grade (campo indicativo de quebra-regra, faltante responsável pelo atraso e justificativa).

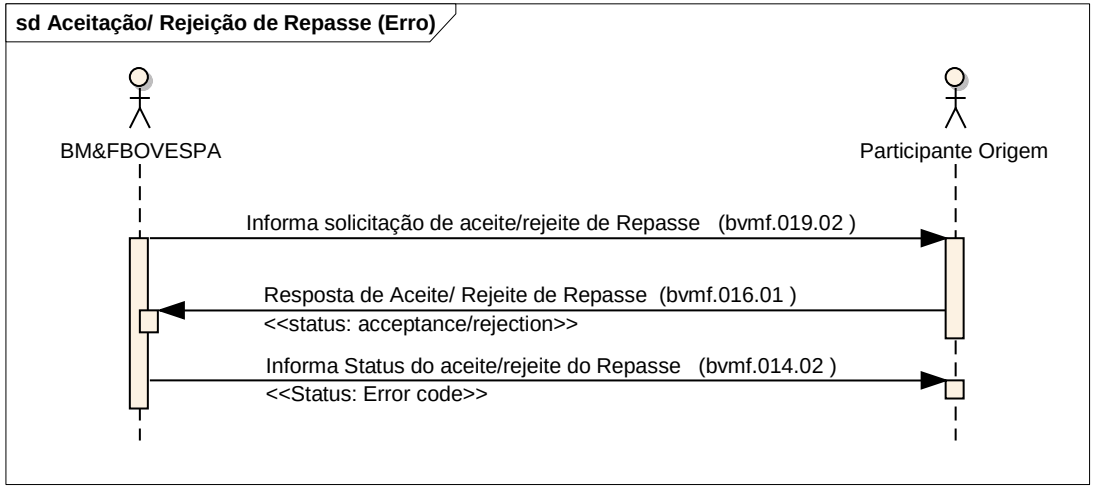
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Origem informando a existência de cancelamento de repasse com pendência de aceitação/rejeição. Nesta mensagem serão informados o atributo indicativo de quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso.
- O Participante Origem pode enviar a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) aceitando ou rejeitando a solicitação de cancelamento de repasse.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do cancelamento do repasse (aceito ou rejeitado).


sd Rejeição de Repasse Fora da Grade
BM&FBOVESPA
Participante Origem
Participante Destino
Resposta de Rejeição de Repasse (bvmf.016.01)
«status: rejection (with Off-Hour attributes)»
Informa solicitação de aceite/rejeite de Repasse (bvmf.019.02)
<<status: Pending TakeUp CancellationApproval>>
Resposta de Aceite/ Rejeite de Repasse (bvmf.016.01)
«status: acceptance/rejection»
Informa Status da aceitação do Repasse (bvmf.014.02)
<<status: TakeUp Cancellation approved/rejected by GiveUp Participant>>
Informa Status da aceitação do Repasse (bvmf.014.02)
<<status: TakeUp Cancellation approved/rejected by GiveUp Participant>>

Cenário3: Cancelamento de repasse de Operações realizado fora da grade – Aceito ou Rejeitado ativamente pelo Participante Origem - com erro

Este cenário é de uma solicitação de aceitação ou rejeição de cancelamento de repasse com erro de negócio (validação com base em um conjunto de regras pré-definidas).

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Origem informando a existência de cancelamento de repasse com pendência de aceitação/rejeição. Nesta mensagem serão informados o atributo indicativo de quebra-regra, bem como o faltante responsável pelo atraso.
- O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) com a aceitação ou com a rejeição do cancelamento de repasse do negócio contendo alguma não-conformidade;
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) respondendo ao Participante Destino a situação de erro com seu respectivo código.



Fluxo de Mensagens - ETF

Informa Integralização/Resgate de Cotas (ETF) Realizado

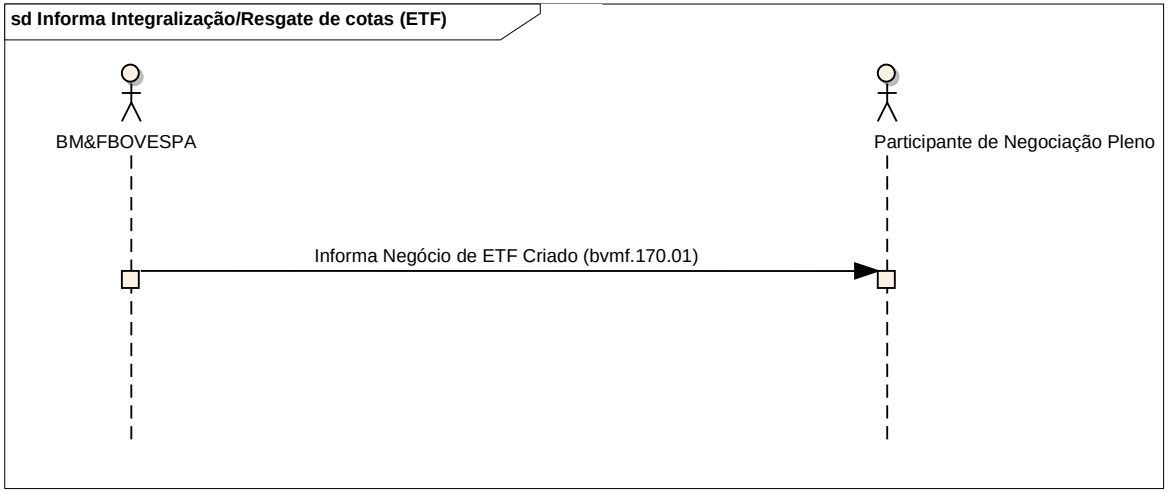
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem ETFTradeNotification para informar realização de operações de Integralização/Resgate de ETF Primário.

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Negócio de ETF Realizado no Mercado Primário

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a realização de Integralização/Resgate de ETF.

- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem ETFTradeNotification (bvmf.170.01) ao Participante de Negociação Pleno executor do negócio informando a Integralização/Resgate de cotas (ETF) realizada no sistema primário de negociação, e seu detalhamento.


sd Informa Integralização/Resgate de cotas (ETF)
BM&FBOVESPA
Participante de Negociação Pleno
Informa Negócio de ETF Criado (bvmf.170.01)

Informa Integralização/Resgate de Cotas (ETF) Cancelado

Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem TradeLegNotificationCancellation em típicos cenários sequenciais entre duas partes para informar o cancelamento de operação de Integralização/Resgate de cotas realizada.

Obs.: O cancelamento do protocolo do ETF implica em cancelamento de todos os negócios gerados na operação de integralização/resgate.

O detalhamento deste fluxos encontra-se no item Informa Negócio Cancelado.

Repasse de Operações de ETF

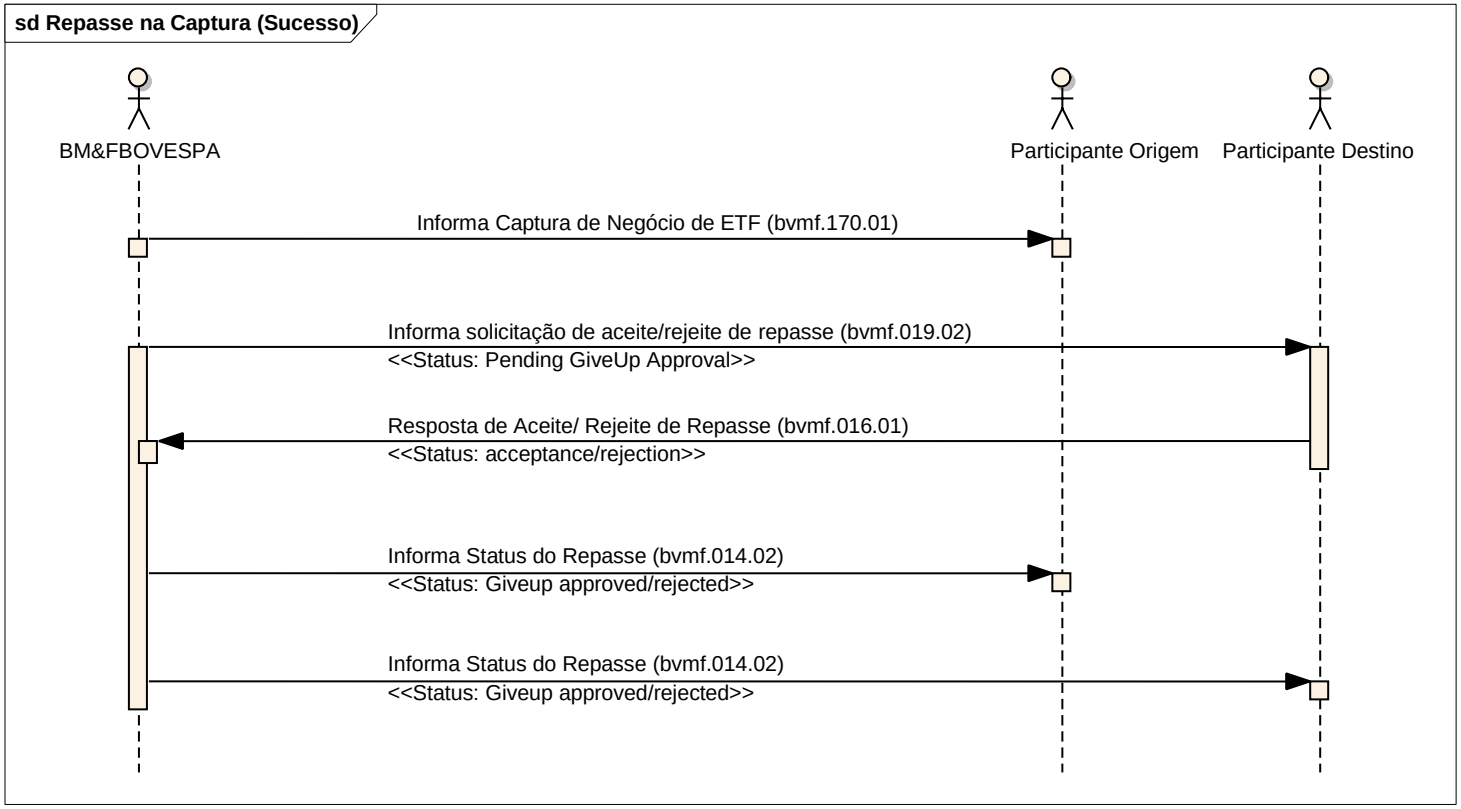
Introdução

Esta seção ilustra fluxos de repasse de operações em típicos cenários sequenciais para informar repasse realizado com sucesso ou erro. O repasse pode ocorrer na captura do negócio realizado (caso a conta capturada na ordem possua vínculo de repasse) ou na inclusão de alocação (caso a conta alocada possua vínculo de repasse).

Cenário1: Repasse na Captura do Negócio de ETF

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a captura de um negócio com repasse.

- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem ETFTradeNotification (bvmf.170.01) ao Participante de Negociação Pleno executor do negócio informando a Integralização/Resgate de cotas (ETF) realizada no sistema primário de negociação e seu detalhamento. Esta mensagem possui atributos que permitem identificar que o negócio foi repassado para um Participante Destino.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem InformGiveUpPendingApproval (bvmf.019.02) para o Participante Destino informando a existência de negócios advindos de repasse com pendência de aceitação/rejeição.
- O Participante Destino pode enviar a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection (bvmf.016.01) aceitando ou rejeitando o repasse de negócio.
-A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) informando ao Participante Origem e Participante Destino a situação final do repasse (repasse aprovado ou rejeitado).


sd Repasse na Captura (Sucesso)
BM&FBOVESPA
Participante Origem
Participante Destino
Informa Captura de Negócio de ETF (bvmf.170.01)
Informa solicitação de aceite/rejeite de repasse (bvmf.019.02)
<<Status: Pending GiveUp Approval>>
Resposta de Aceite/ Rejeite de Repasse (bvmf.016.01)
<<Status: acceptance/rejection>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: Giveup approved/rejected>>
Informa Status do Repasse (bvmf.014.02)
<<Status: Giveup approved/rejected>>

Atualização de Preço/Ajuste de ETF Realizado no Mercado Primário

Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem ETFTradeNotification e/ouSecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice em típicos cenários sequenciais informando aos participantes a atualização de Preço/ Ajuste de ETF realizado no Mercado Primário.

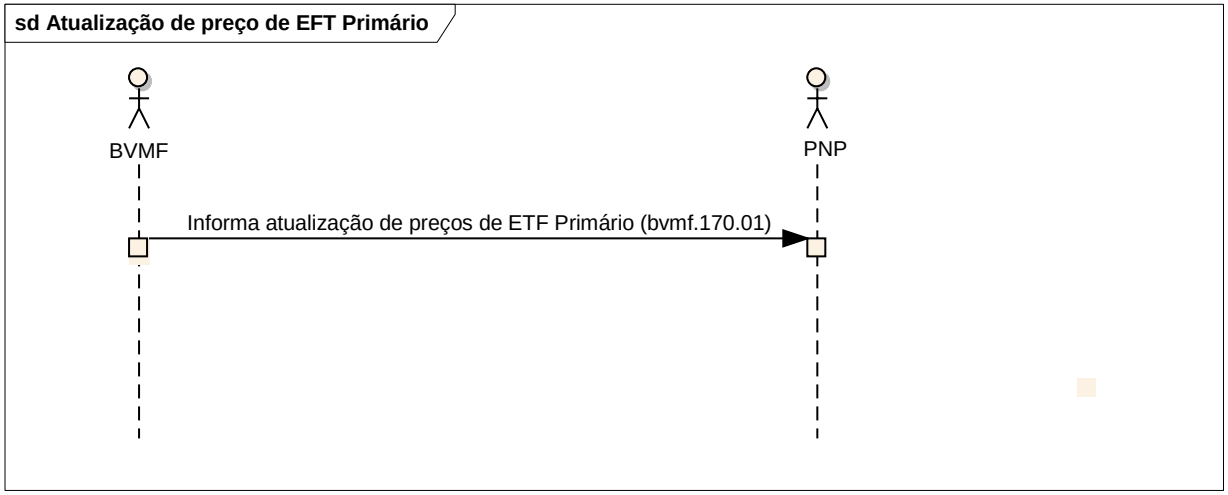
Caso o negócio de ETF realizado no Mercado Primário não envolva cenários de repasse, então:
- O Participante Negociador receberá notificação de atualização de preço/ajuste através da mensagem ETFTradeNotification;

Caso o negócio de ETF realizado no Mercado Primário envolva cenários de repasse, então:
- O Participante Destino receberá notificação de atualização de preço/ajuste através da mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice;
-O Participante Origem receberá notificação de atualização de preço/ajuste através das mensagens ETFTradeNotification e SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice;

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Atualização de Preço/Ajuste de ETF Realizado no Mercado Primário – Cenário Sem Repasse

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a atualização de preço /ajuste de ETF Primário.

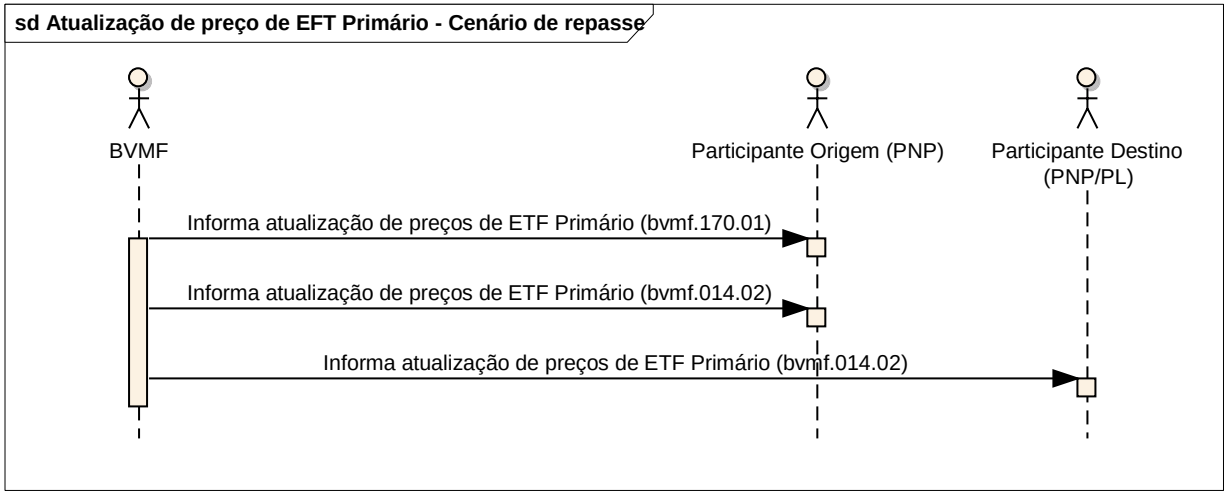
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem ETFTradeNotification (bvmf.170.01) ao Participante Negociador informando os preços definitivos ou provisórios e ajuste dos negógios de Integralização/resgate de ETF realizadas no Mercado Primário.



Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Atualização de Preço de ETF Realizado no Mercado Primário – Cenário com Repasse

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a atualização de preço/ajuste de ETF Primário.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem ETFTradeNotification (bvmf.170.01) ao Participante Origem de Repasse informando os preços definitivos ou provisórios e ajuste dos negócios de Integralização/resgate de ETF realizadas no mercado Primário.
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.02) aos Participantes Origem e Destino de Repasse informando os preços definitivos ou provisórios e ajuste dos negógios de Integralização/resgate de ETF realizadas no mercado Primário.


sd Atualização de preço de EFT Primário - Cenário de repasse
BVMF
Participante Origem (PNP)
Participante Destino (PNP/PL)
Informa atualização de preços de ETF Primário (bvmf.170.01)
Informa atualização de preços de ETF Primário (bvmf.014.02)
Informa atualização de preços de ETF Primário (bvmf.014.02)

Arquivos de consultas de negócios realizados, alocação e repasse de operações

Introdução

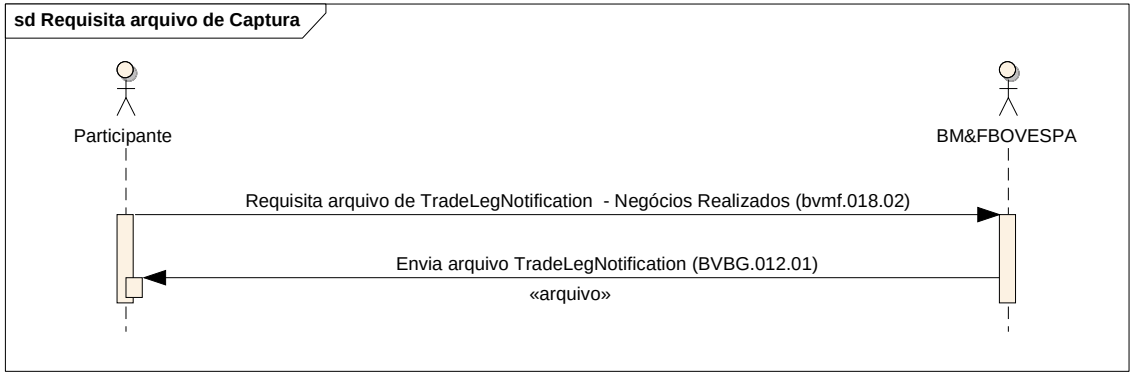
Os fluxos ilustram o uso da mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) em típicos cenários sequenciais entre duas partes para solicitar os seguintes arquivos de consulta:

- Negócios Realizados (TradeLegNotification – BVBG 012.01)
- Negócios Alocados (SecuritiesAllocationDetails – BVBG.013.02)
- Repasses enviados – origem (GiveUpTradeDetails – BVBG.014.02)
- Repasses recebidos – destino (TakeUpTradeDetails – BVBG.015.02)

Arquivo "TradeLegNotification" (BVBG.012.01) – Negócios Realizados

Cenário1: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados.

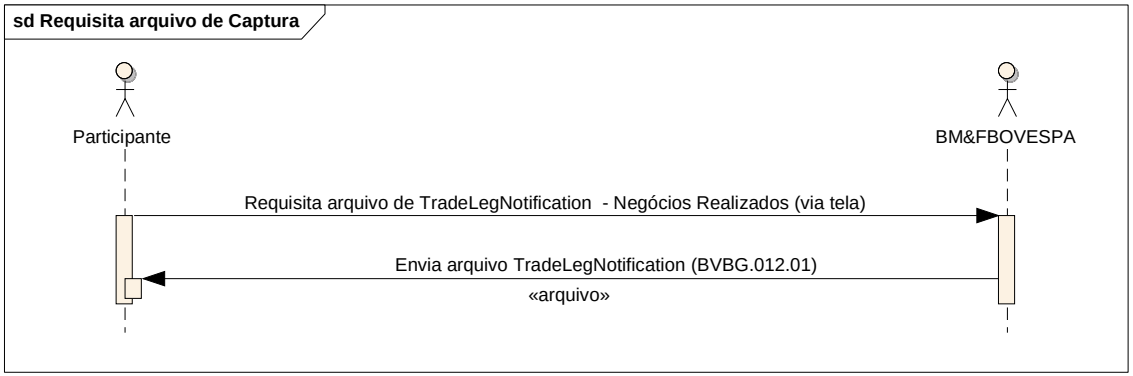
- O Participante de Negociação Pleno envia a mensagem "TradeManagementReportRequest" (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios realizados. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo "TradeLegNotification".
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo "TradeLegNotification" (BVBG.012.01) para o Participante de Negociação Pleno que executou o negócio no sistema de negociação.



Cenário2: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados.

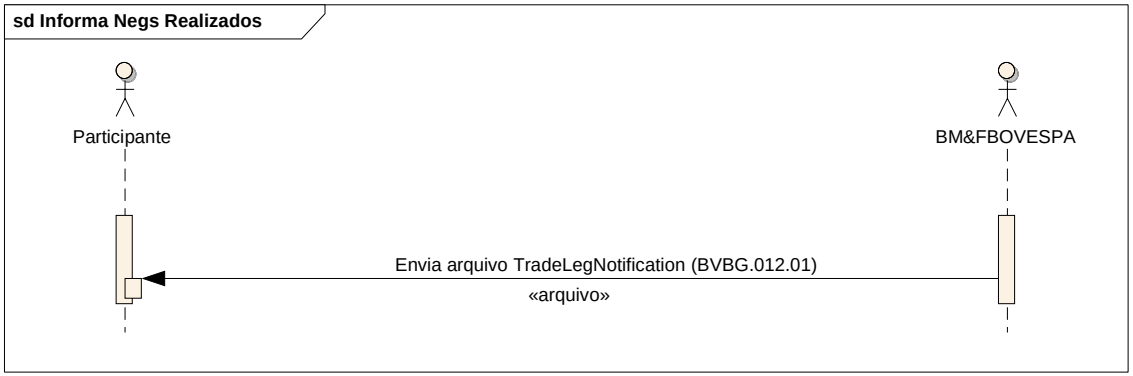
(Via tela)

- O Participante de Negociação Pleno requisita via tela, o arquivo de consulta de negócios realizados.
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo “TradeLegNotification” (BVBG.012.01) para o Participante de Negociação Pleno que executou o negócio no sistema de negociação.



Cenário3: BM&FBOVESPA informa negócios realizados

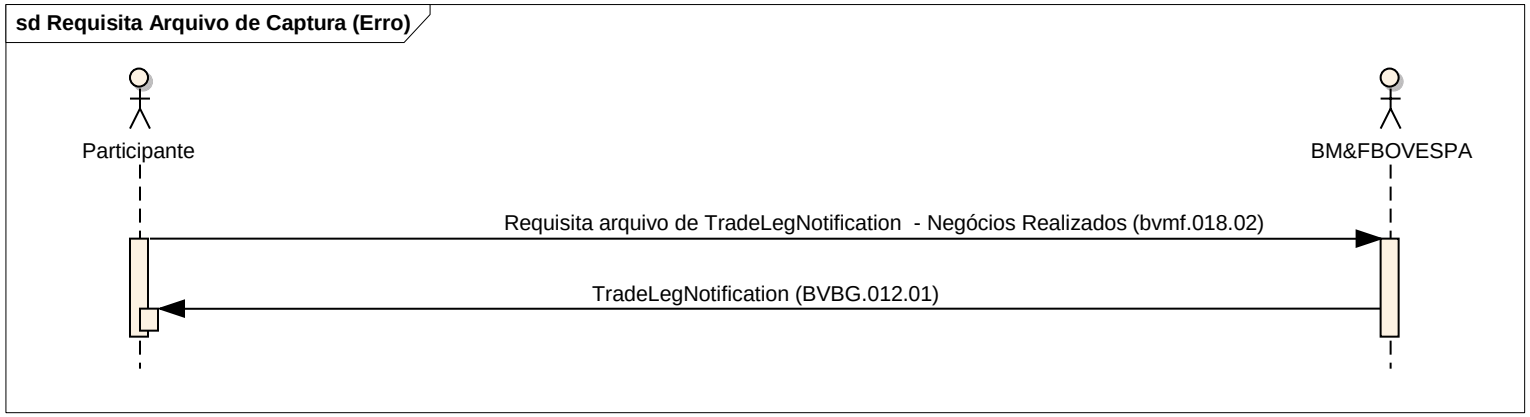
A BM&FBOVESPA informa ao Participante de Negociação Pleno, ao final do dia, os negócios realizados no dia através do arquivo BVBG.012.01 – Arquivo de Negócios Realizados (“TradeLegNotification”).



Cenário4: Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados.

Cenário de Erro

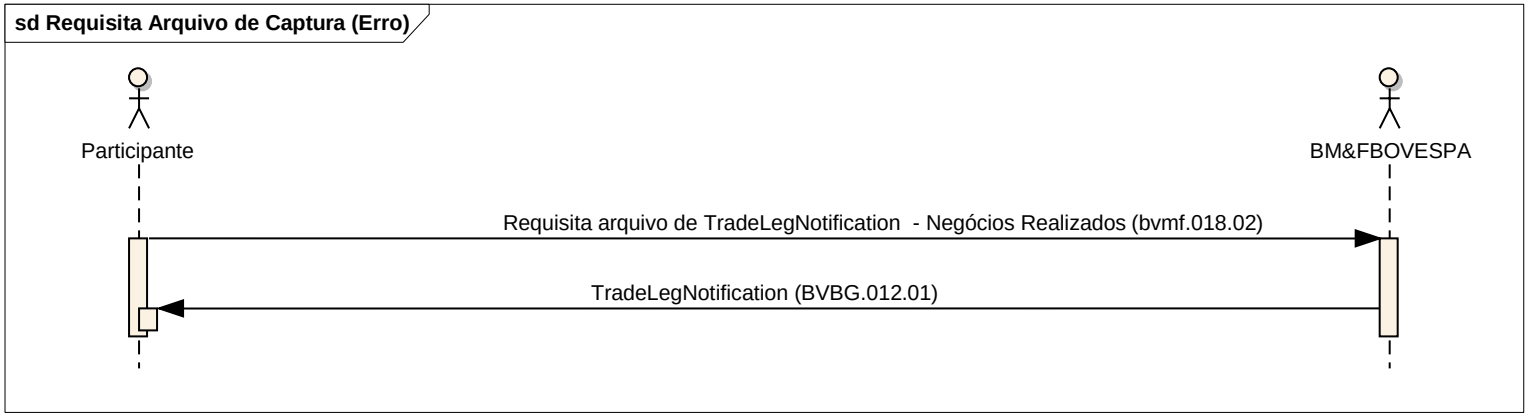
- O Participante de Negociação Pleno envia a mensagem “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios realizados, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo TradeLegNotification (BVBG.012.01) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.



Cenário 5 Participante solicita arquivo de consulta de negócios realizados.

Arquivo vazio

- O Participante de Negociação Pleno envia a mensagem “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios realizados.
- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo TradeLegNotification (BVBG.012.01) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01).

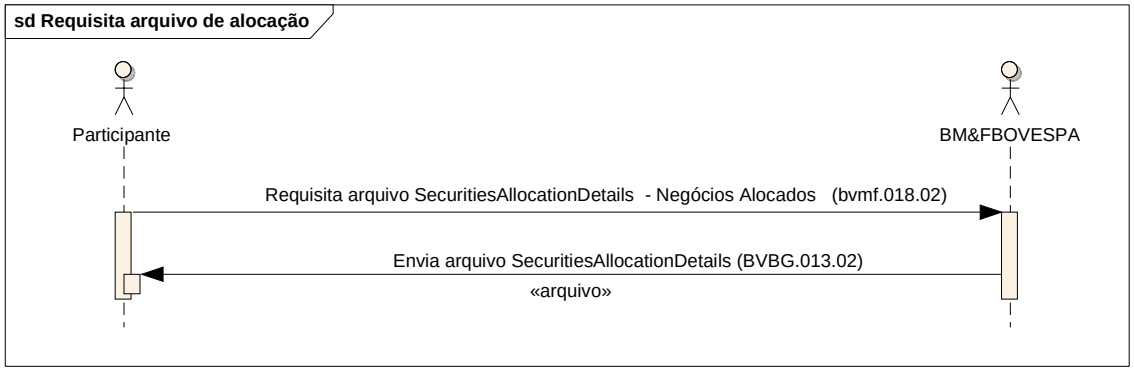


Arquivo "SecuritiesAllocationDetails" (BVBG.013.02) – Negócios Alocados

Cenário1: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados.

- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia envia a mensagem "TradeManagementReportRequest" (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios alocados. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo "SecuritiesAllocationDetails" (Negócios Alocados).

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02) para o Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia com as informações encontradas na consulta.
- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02) apenas com o bloco "Parâmetros de Relatório" preenchido.

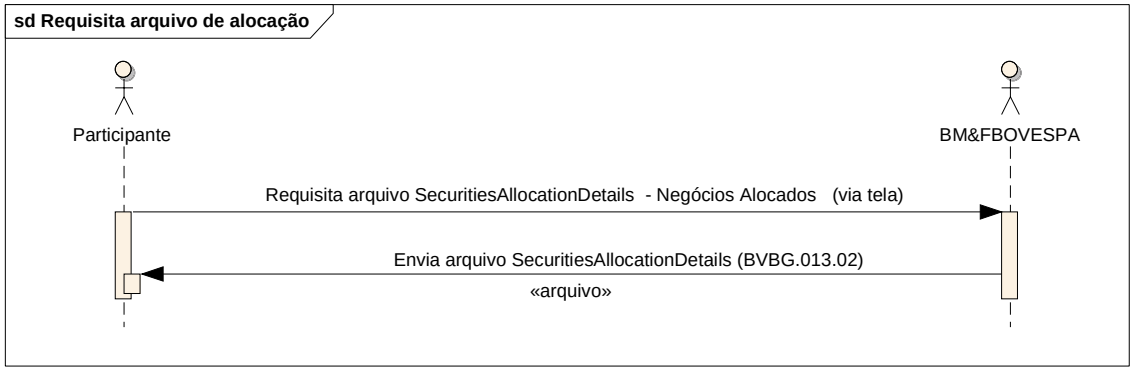


Cenário2: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados.

(Via tela)

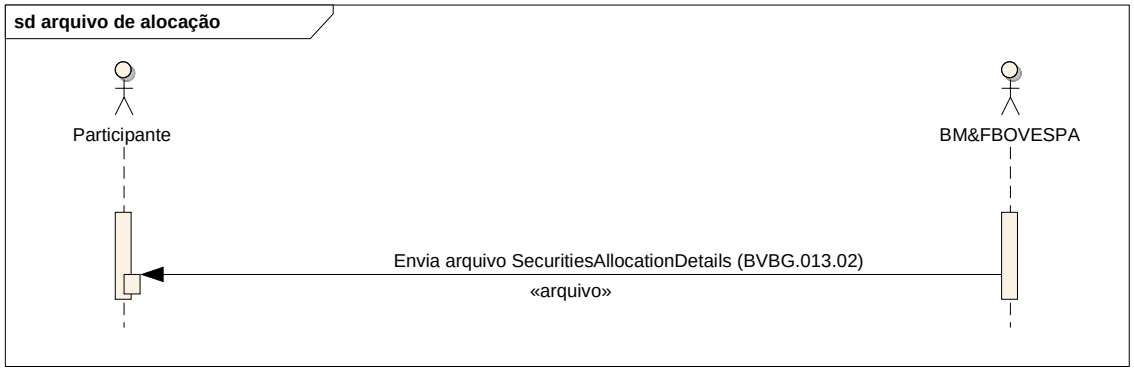
- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia requisita via tela, o arquivo de consulta de negócios alocados.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02) para o Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia com as informações encontradas na consulta.
- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02) apenas com o bloco “Parâmetros de Relatório” preenchido.



Cenário3: BM&FBOVESPA informa negócios alocados

A BM&FBOVESPA informa ao Participante de Negociação Pleno e ao Participante de Liquidação, ao final do dia, os negócios alocados, através do arquivo BVBG.013.02 – Arquivo de Negócios Alocados (“SecuritiesAllocationDetails”).

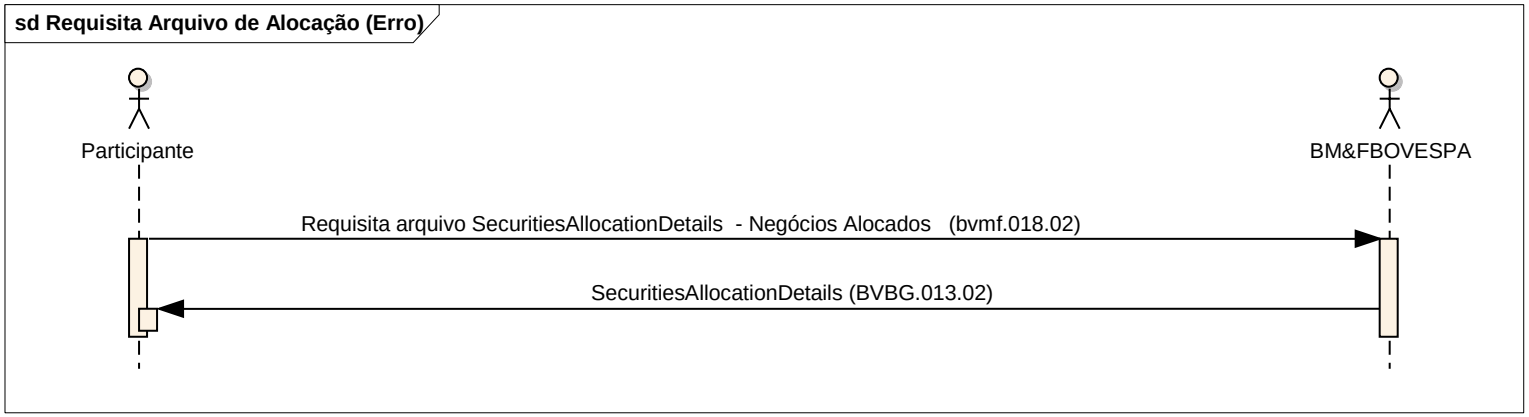


Cenário4: Participante solicita arquivo de Negócios Alocados.

Cenário de Erro.

- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia envia a mensagem “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios alocados, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.



Arquivo "GiveUpTradeDetails" (BVBG.014.02) - Repasses Enviados pelo Participante Origem do repasse

Cenário1: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados.

- O Participante de Negociação Pleno atuando como participante origem do repasse, envia a mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de repasses enviados pelo Participante. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo GiveUpTradeDetails (Negócios Repassados - origem).

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02) para o Participante de Negociação Pleno com as informações encontradas na consulta.

- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02) apenas com o bloco "Parâmetros de Relatório" preenchido.

Cenário2: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados.

(Via tela)

- O Participante de Negociação Pleno atuando como participante origem do repasse, requisita via tela, o arquivo de repasses enviados pelo Participante.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02) para o Participante de Negociação Pleno com as informações encontradas na consulta.

- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02) apenas com o bloco “Parâmetros de Relatório” preenchido.

sd Requisita arquivo de repasse (Give Up)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta GiveUpTradeDetails -Negócios Repassados - Origem (via tela)
Envia arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02)
«arquivo»

Cenário3: BM&FBOVESPA informa repasses enviados pelo Participante

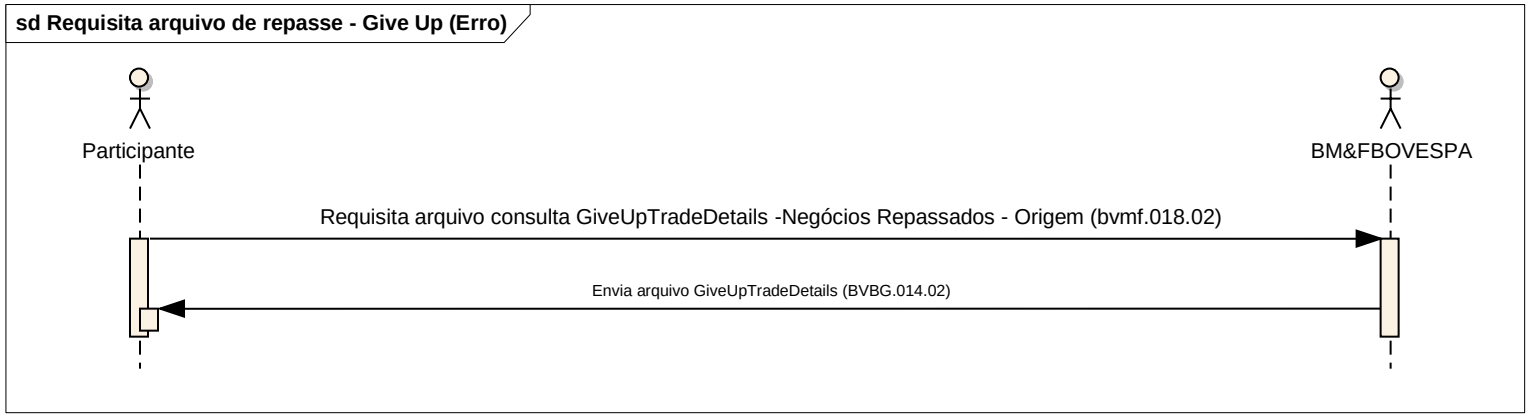
A BM&FBOVESPA informa ao Participante de Negociação Pleno, ao final do dia, os repasses enviados pelo Participante, através do arquivo BVBG.014.02 – Arquivo de Repasses Enviados - origem (“GiveUpTradeDetails”).

Cenário4: Participante Origem do repasse solicita arquivo Repasses Enviados.

Cenário de Erro.

- O Participante de Negociação Pleno atuando como participante origem do repasse, envia a mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de repasses enviados pelo Participante, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Requisita arquivo de repasse - Give Up (Erro)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta GiveUpTradeDetails -Negócios Repassados - Origem (bvmf.018.02)
Envia arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02)

Arquivo "TakeUpTradeDetails" (BVBG.015.02) - Repasses Recebidos pelo Participante Destino do repasse

Cenário1: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação atuando como participante destino do repasse, envia a mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios recebidos por repasse. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo TakeUpTradeDetails (Negócios Recebidos por Repasse - destino).

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com as informações encontradas na consulta.

- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) apenas com o bloco "Parâmetros de Relatório" preenchido.

sd Requisita arquivo de repasse (Take Up)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta TakeUpTradeDetails - Negócios recebidos por Repasse (bvmf.018.02)
Envia arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02)
«arquivo»

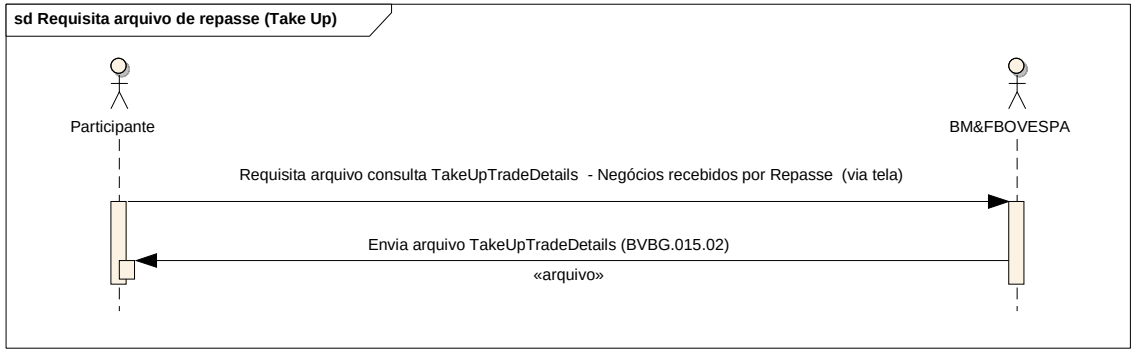
Cenário2: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante.

(Via tela)

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação atuando como participante destino do repasse, requisita via tela, o arquivo de consulta de negócios recebidos por repasse.

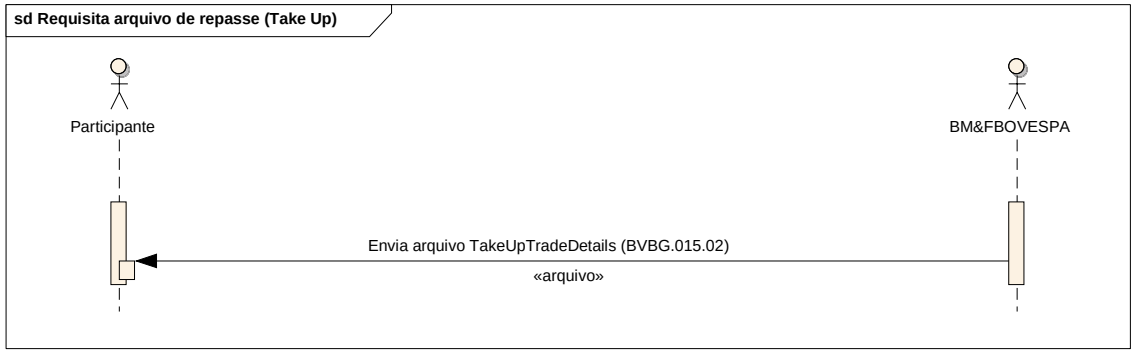
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com as informações encontradas na consulta.

- Se a consulta não gerar informações, a BM&FBOVESPA enviará o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) apenas com o bloco “Parâmetros de Relatório” preenchido.


sd Requisita arquivo de repasse (Take Up)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta TakeUpTradeDetails - Negócios recebidos por Repasse (via tela)
Envia arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02)
«arquivo»

Cenário3: BM&FBOVESPA informa repasses recebidos pelo Participante

A BM&FBOVESPA informa ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, ao final do dia, os repasses recebidos, através do arquivo BVBG.015.02 – Arquivo de Repasses Recebidos (“TakeUpTradeDetails”).



Cenário4: Participante Destino do repasse solicita arquivo de consulta de repasses recebidos pelo Participante.

Cenário de Erro.

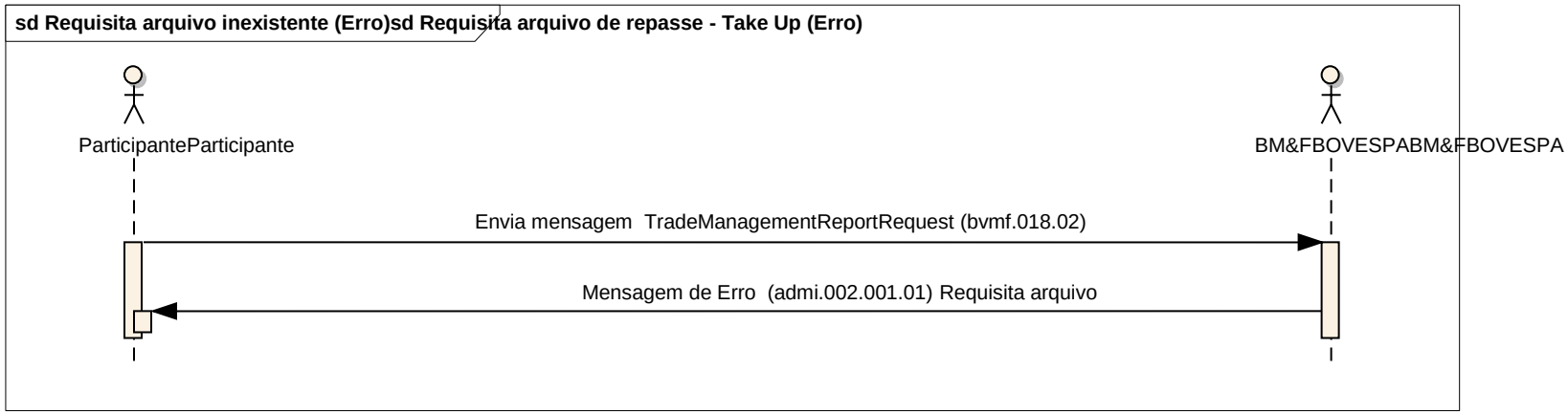
- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação atuando como participante destino do repasse, envia a mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) requisitando o arquivo de consulta de negócios recebidos por repasse, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.

Requisita arquivo consulta TakeUpTradeDetails - Negócios recebidos por Repasse (bvmf.018.02)
Envia arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02)

Cenário 1: Participante envia mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) com erro no ExternalReportTypeCode

- O Participante envia a mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), cujo processamento da requisição apresentou inconsistência na validação de negócio por apresentar campos fora dos parâmetros especificados (por exemplo, requisição de um arquivo não listado no ExternalReportTypeCode).
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem de erro de negócio (admi.002.001.01).


sd Requisita arquivo inexistente (Erro)sd Requisita arquivo de repasse - Take Up (Erro)
ParticipanteParticipante
BM&FBOVESPABM&FBOVESPA
Envia mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01) Requisita arquivo

Fluxo de Mensagens - Hash

Conciliação da alocação

Introdução

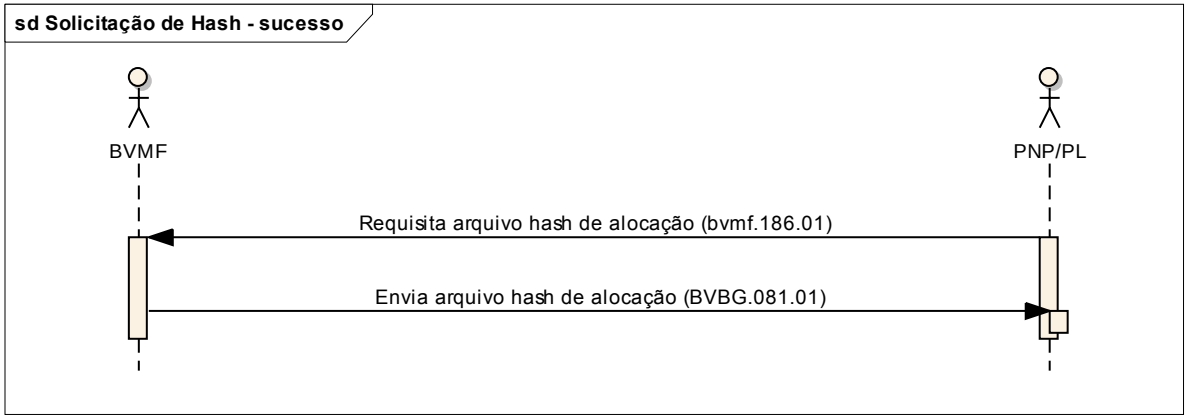
Este fluxo ilustra o uso da mensagem AllocationHashRequest para requisitar a conciliação da alocação.

Cenário1: Participante solicita informações do hash.

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a conciliação da alocação.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem AllocationHashRequest (bvmf.186.01) à BM&FBOVESPA requisitando o hash para que seja possível a conciliação da alocação.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo AllocationHashResponse (BVBG.081.01) para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação para informar o hash solicitado.

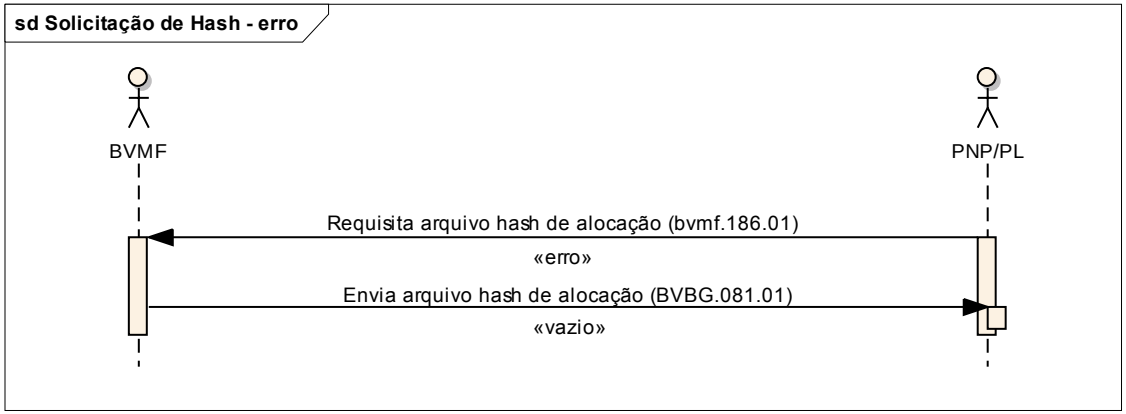

sd Solicitação de Hash - sucesso
BVMF
PNP/PL
Requisita arquivo hash de alocação (bvmf.186.01)
Envia arquivo hash de alocação (BVBG.081.01)

Cenário2: Participante solicita informações do hash.

Cenário de Erro

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem AllocationHashRequest (bvmf.186.01) à BM&FBOVESPA requisitando o hash, com alguma não-conformidade.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo AllocationHashResponse (BVBG.081.01) vazio para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.


sd Solicitação de Hash - erro
BVMF
PNP/PL
Requisita arquivo hash de alocação (bvmf.186.01)
«erro»
Envia arquivo hash de alocação (BVBG.081.01)
«vazio»

Arquivos de Contingência

Introdução

Esta sessão tem como objetivo detalhar os arquivos de contingência que poderão ser utilizados pelo participante no caso de indisponibilidade no serviço de mensageria. Os arquivos de contingência contemplam os processos básicos de alocação, não sendo considerados uma substituição aos meios principais (mensagens).

Os arquivos cobrem os seguintes processos de negócios:

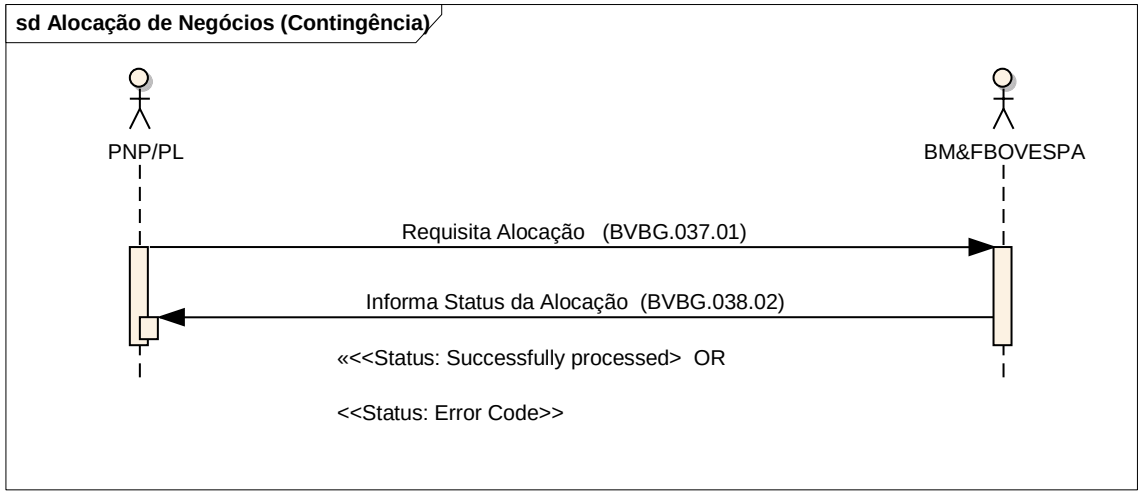
Processo	Nome do Arquivo	Sigla do arquivo	Conteúdo do arquivo
Participante solicita alocação/repasse	SecuritiesAllocationInstruction	BVBG.037.01	bvmf.013.01
BM&FBOVESPA informa retorno da solicitação enviada	SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice	BVBG.038.02	bvmf.014.02 tsmt.016.001.03 admi.002.001.01
Participante solicita exclusão de alocação	SecuritiesAllocationInstructionCancellation	BVBG.039.01	bvmf.015.01
Participante solicita arquivo de consulta	TradeManagementReportRequest	BVBG.040.02	bvmf.018.02

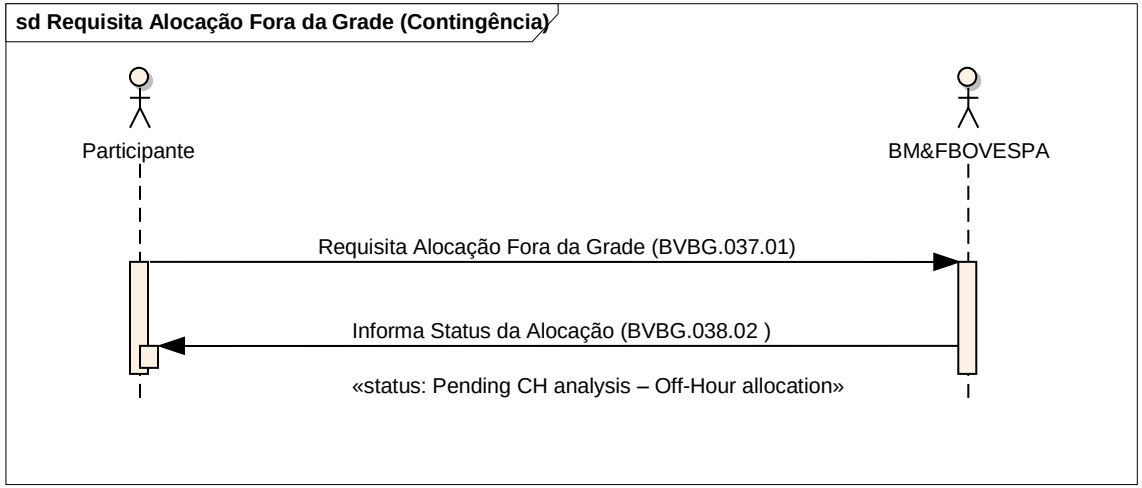
Inclusão de Alocação ou Repasse por meio de arquivo de contingência (BVBG.037.01)

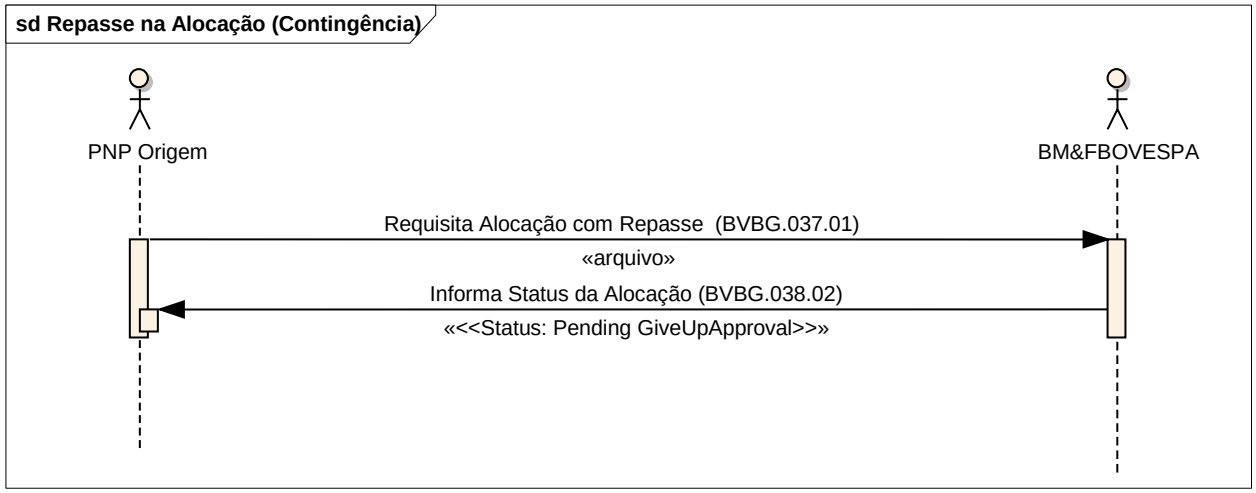
Cenário 1: Inclusão de Alocação ou Repasse de Negócios por meio de arquivo de contingência

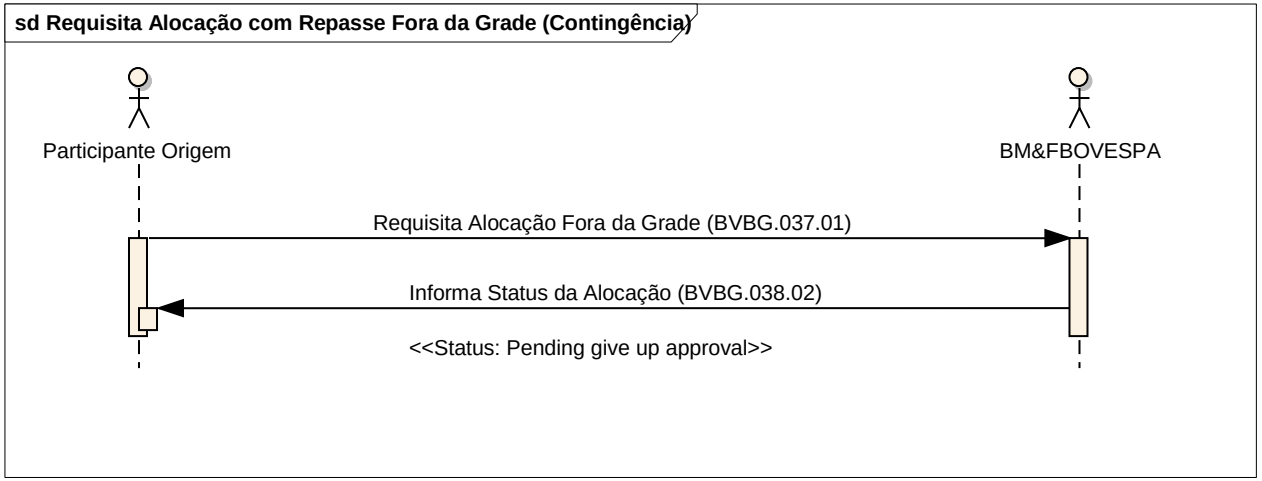
O intuito desse fluxo é representar o envio do arquivo BVBG.037.01, contendo diversas mensagens bvmf.013.01, para solicitação de alocação ou repasse de negócios. As mensagens bvmf.013.01 podem ser utilizadas para solicitação de alocação ou repasse dentro ou fora da grade horária.
Caso a solicitação de alocação ou repasse seja fora da grade, devem ser informados, obrigatoriamente, todos os detalhes pertinentes à alocação fora da grade (campo indicativo de solicitação quebra-regra, justificativa e faltante (este último, somente se repasse)).

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia um arquivo SecuritiesAllocationInstruction (BVBG.037.01) à BM&FBOVESPA, composto por mensagem(ns) SecuritiesAllocationInstruction (bvmf.013.01), para solicitar a inclusão da alocação e repasse de operações. Caso a alocação ou repasse seja realizada fora da grade, deverão ser preenchidos os campos específicos para este fim.
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (BVBG.038.02), composto por mensagem(ns) SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.01), informando ao Participante a situação das alocações e repasses solicitados .


sd Alocação de Negócios (Contingência)
PNP/PL
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação (BVBG.037.01)
Informa Status da Alocação (BVBG.038.02)
«<<Status: Successfully processed> OR
<<Status: Error Code>>


sd Requisita Alocação Fora da Grade (Contingência)
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação Fora da Grade (BVBG.037.01)
Informa Status da Alocação (BVBG.038.02)
«status: Pending CH analysis – Off-Hour allocation»


sd Repasse na Alocação (Contingência)
PNP Origem
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação com Repasse (BVBG.037.01)
«arquivo»
Informa Status da Alocação (BVBG.038.02)
«<<Status: Pending GiveUpApproval>>»


sd Requisita Alocação com Repasse Fora da Grade (Contingência)
Participante Origem
BM&FBOVESPA
Requisita Alocação Fora da Grade (BVBG.037.01)
Informa Status da Alocação (BVBG.038.02)
<<Status: Pending give up approval>>

Exclusão de Alocação por meio de arquivo de contingência (BVBG.039.01)

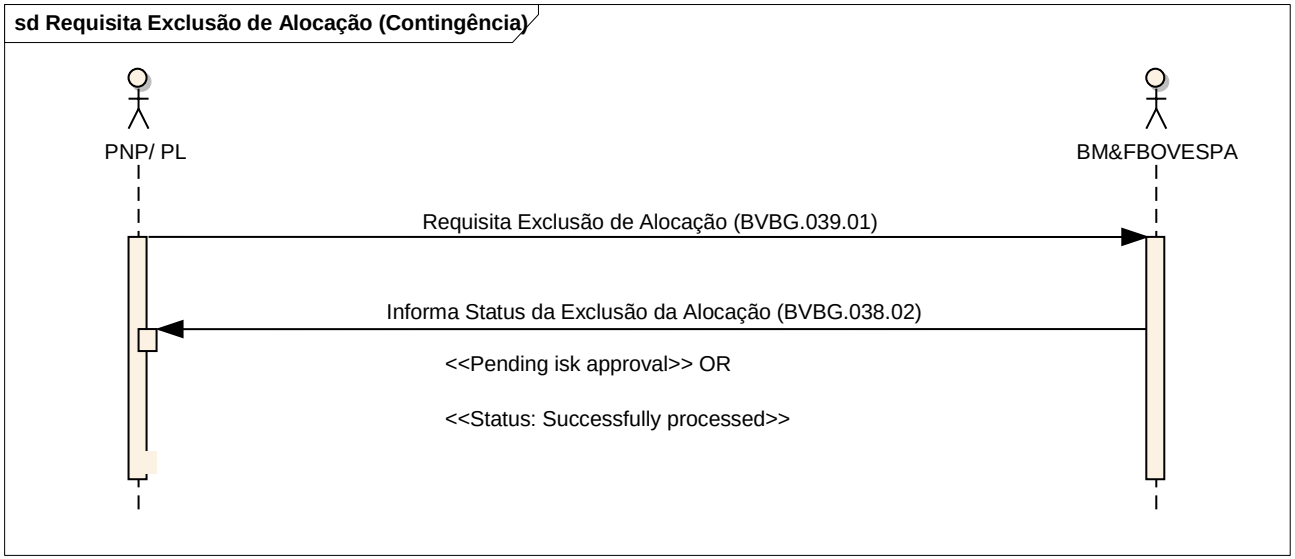
Cenário 1: Exclusão de Alocação de Negócios por meio de arquivo de contingência

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia um arquivo SecuritiesAllocationInstructionCancellation (BVBG.039.01), composto por mensagem(ns) SecuritiesAllocationInstructionCancellation (bvmf.015.01), à BM&FBOVESPA para solicitar a exclusão da alocação de negócio(s).
- A(s) solicitação(ões) de exclusão de alocação são enviadas para análise de risco na BM&FBOVESPA, que poderá: (i) automaticamente aprová-la ou (ii) mantê-la pendente aguardando a análise de risco(por exemplo, aguardando depósito de colaterais)

Como retorno ao arquivo de exclusão de alocação, o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação receberá o arquivo SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (BVBG.038.02), composto por mensagem(ns) SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (bvmf.014.01), informando:

- Para a situação (i), o processamento com sucesso.
- Para a situação (ii), que a solicitação encontra-se pendente de análise de risco.

A BM&FBOVESPA informará no arquivo BVBG.038.02 apenas a primeira situação de cada solicitação (no caso da situação (ii), pendente de análise de risco). Para acompanhamento posterior, é necessário consulta por meio das telas do sistema ou solicitação de arquivo de consulta .



BM&FBOVESPA informa retorno da solicitação enviada por meio de arquivo de contingência (BVBG.038.02)

O arquivo BVBG.038.02 "SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice" é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação como retorno ao arquivo BVBG.037.01 "SecuritiesAllocationInstruction" e BVBG.039.01 "SecuritiesAllocationInstructionCancellation".

Cenário 1 : Participante recebe arquivo ""SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice""– em Contingência

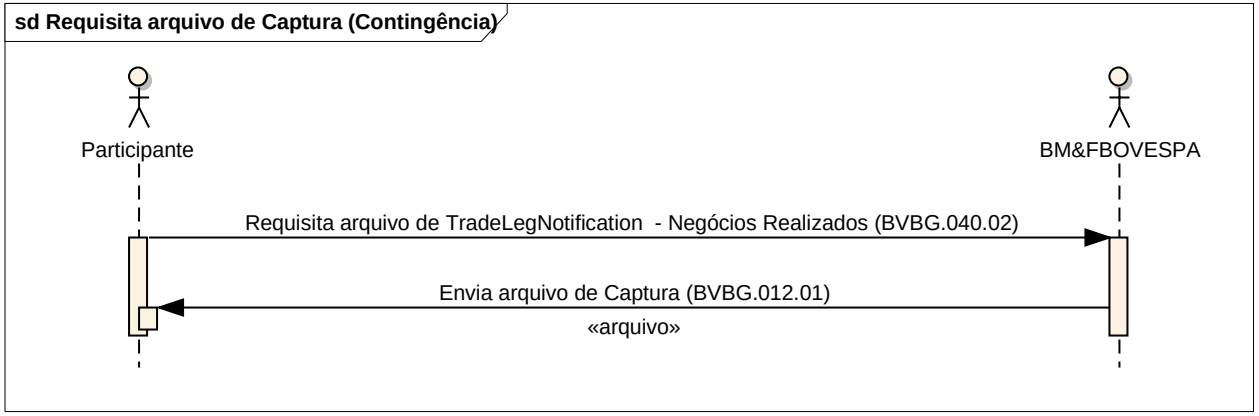
Os possíveis cenários que refletem o uso deste arquivo estão representados nas sessões dos arquivos BVBG.037.01 e BVBG.039.01.

Solicitação de arquivos de consulta de alocação por meio de arquivo de contingência (BVBG.040.02)

Este arquivo é composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) e tem como objetivo solicitar os arquivos de consulta de alocação.

Cenário 1: Participante solicita arquivo "TradeLegNotification" (BVBG.012.01)– em Contingência

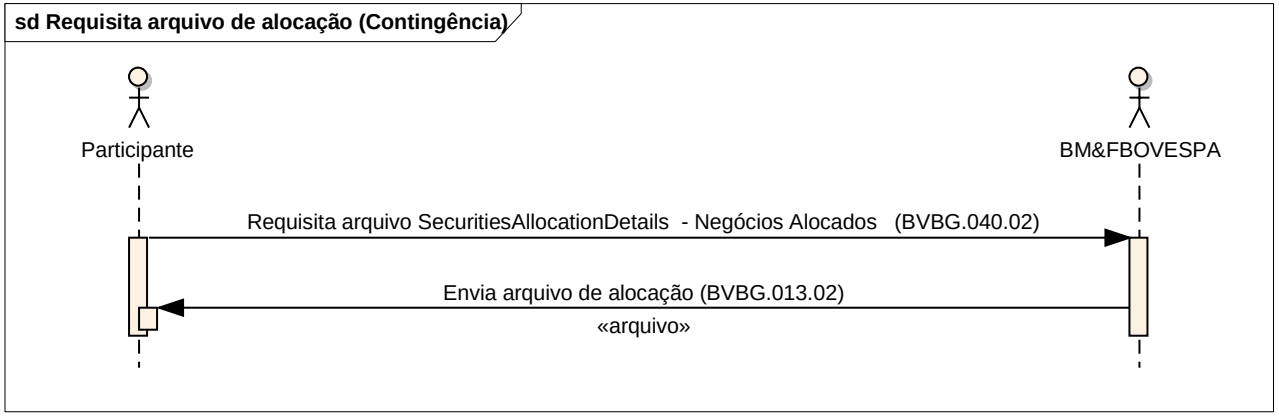
- O Participante de Negociação Pleno envia o arquivo "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), requisitando o arquivo de consulta de negócios realizados. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo "TradeLegNotification".
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo "TradeLegNotification" (BVBG.012.01), composto pela mensagem TradeLegNotification (bvmf.012.01) para o Participante de Negociação Pleno que executou o negócio no sistema de negociação com as informações encontradas na consulta.



Cenário 2: Participante solicita arquivo "SecuritiesAllocationDetails" (BVBG.013.02) – em Contingência

- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia envia o arquivo "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), requisitando o arquivo de consulta de negócios alocados. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo "SecuritiesAllocationDetails" (Negócios Alocados).

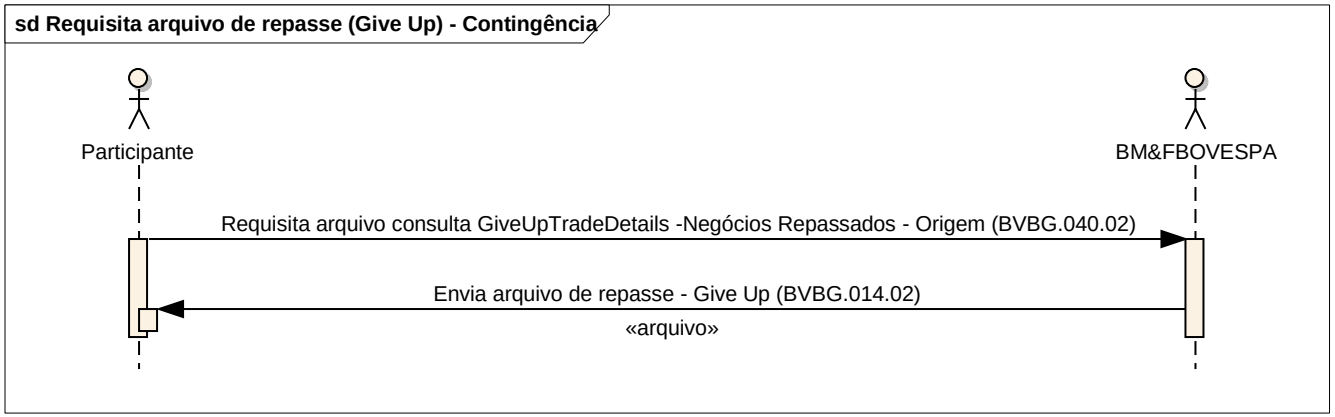
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo SecuritiesAllocationDetails (BVBG.013.02), composto pela mensagem SecuritiesAllocationDetails (bvmf.020.02) para o Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia com as informações encontradas na consulta.



Cenário 3: Participante Origem do repasse solicita arquivo "GiveUpTradeDetails" (BVBG.014.02) – em Contingência

- O Participante de Negociação Pleno atuando como participante origem do repasse, envia o arquivo TradeManagementReportRequest (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), requisitando o arquivo de repasses enviados pelo Participante. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo GiveUpTradeDetails (Negócios Repassados - origem).

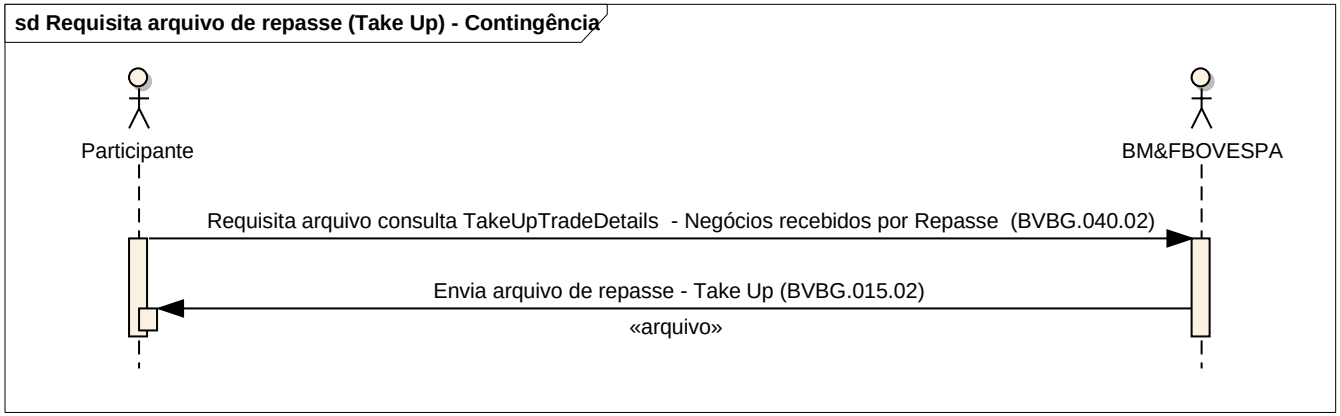
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo GiveUpTradeDetails (BVBG.014.02), composto pela mensagem GiveUpTradeDetails (bvmf.021.02) para o Participante de Negociação Pleno com as informações encontradas na consulta.


sd Requisita arquivo de repasse (Give Up) - Contingência
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta GiveUpTradeDetails -Negócios Repassados - Origem (BVBG.040.02)
Envia arquivo de repasse - Give Up (BVBG.014.02)
«arquivo»

Cenário 4: Participante Destino do repasse solicita arquivo "TakeUpTradeDetails" (BVBG.015.02) – em Contingência

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação atuando como participante destino do repasse, envia o arquivo TradeManagementReportRequest (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), requisitando o arquivo de consulta de negócios recebidos por repasse. No campo tipo de relatório (Report Type), é selecionado o arquivo TakeUpTradeDetails (Negócios Recebidos por Repasse - destino).

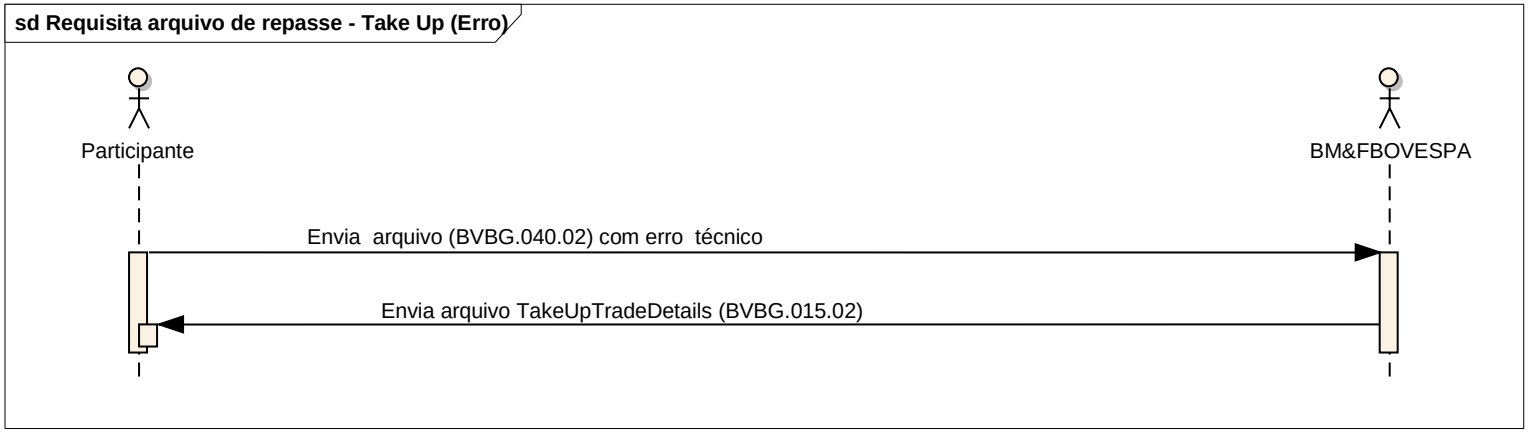
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02), composto pela mensagem TakeUpTradeDetails (bvmf.022.02) para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com as informações encontradas na consulta.


sd Requisita arquivo de repasse (Take Up) - Contingência
Participante
BM&FBOVESPA
Requisita arquivo consulta TakeUpTradeDetails - Negócios recebidos por Repasse (BVBG.040.02)
Envia arquivo de repasse - Take Up (BVBG.015.02)
«arquivo»

Cenário 5: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) contendo erro de negócio

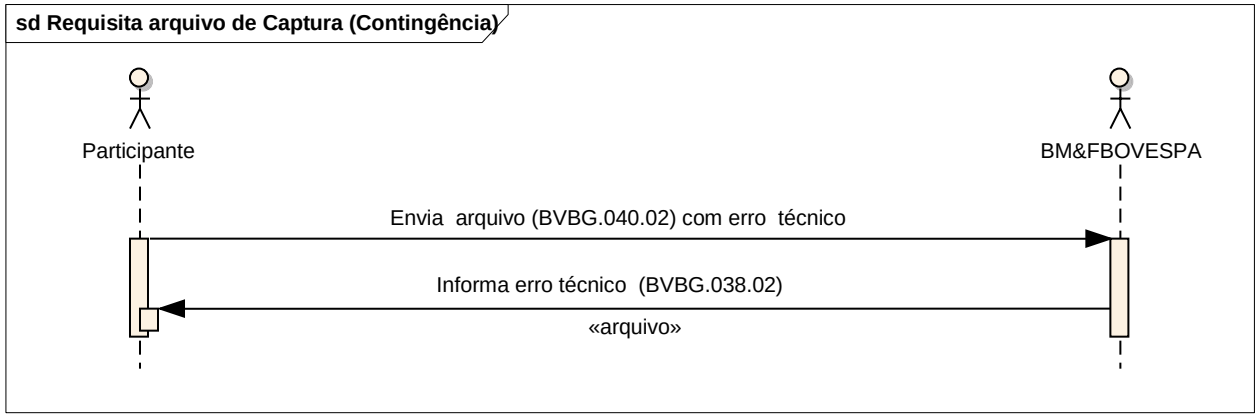
- O Participante envia o arquivo "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) para solictar um dos arquivos listados: BVBG.012.01, BVBG.013,02, BVBG.014.02 ou BVBG.015.02, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia o arquivo solitado, por exemplo: TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02) contendo a mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Requisita arquivo de repasse - Take Up (Erro)
Participante
BM&FBOVESPA
Envia arquivo (BVBG.040.02) com erro técnico
Envia arquivo TakeUpTradeDetails (BVBG.015.02)

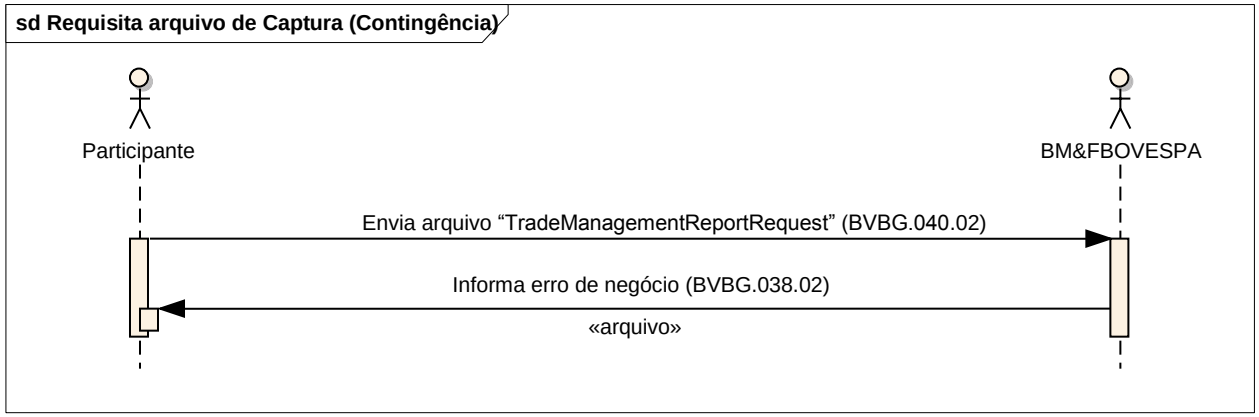
Cenário 6: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) contendo erro técnico.

- O Participante envia o arquivo "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02) com erro técnico (schemma).
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo BVBG.038.02, composto pela mensagem de erro técnico (tsmt.016.001.03) para informar o erro técnico ao Participante que solicitou o arquivo.



Cenário 7: Participante envia arquivo de solicitação de consulta "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02) – com ExternalReportTypeCode errado.

- O Participante envia o arquivo "TradeManagementReportRequest" (BVBG.040.02), composto pela mensagem TradeManagementReportRequest (bvmf.018.02), cujo processamento da requisição apresentou inconsistência na validação de negócio por apresentar campos fora dos parâmetros especificados (por exemplo, requisição de um arquivo não listado no ExternalReportTypeCode).
- A BM&FBOVESPA envia o arquivo BVBG.038.02, composto pela mensagem de erro de negócio (admi.002.001.01) para informar o erro de negócio ao Participante que solicitou o arquivo.


sd Requisita arquivo de Captura (Contingência)
Participante
BM&FBOVESPA
Envia arquivo “TradeManagementReportRequest” (BVBG.040.02)
Informa erro de negócio (BVBG.038.02)
«arquivo»

Tabela

O quadro abaixo resume todos as situações de alocação possíveis e como seriam representados em cada arquivo de consulta.

	BVBG.013.02		BVBG.014.02	BVBG.015.02	BVBG.012.01
Situação	PartOrigem	PartDestino*	PartOrigem*	PartDestino*	
Successfully processed	1				Não se aplica
Pending due to Risk Assessment	6				
Pending CH analysis - Off-Hour allocation	7				
Off-Hour Rejected By the Clearinghouse	12				
Risk Approval Rejected	15				
Pending Give Up Approval			3	3	
GiveUp Approved		1	4	4	
GiveUp Rejected	1		5	5	
Pending Take Up Cancellation Approval			8	8	
TakeUp Cancellation Accepted by GiveUp Participant	1		9	9	
TakeUp Cancellation Rejected by GiveUp Participant		1	10	10	

*Aplicável quando envolver repasse

Status da alocação:

1	Successfully processed
2	Error Code
3	Pending Give up Approval
4	GiveUp Approved
5	GiveUp Rejected
6	Pending due to Risk Assessment
7	Pending CH analysis - Off-Hour allocation
8	Pending TakeUp Cancellation Approval
9	Take-up cancellation approved by give-up participant
10	Take-up cancellation rejected by give-up participant
12	Off-Hour rejected by Clearinghouse
15	Risk Approval Rejected

bvmf.012.01 – TradeLegNotification

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem de Negócio Realizado "TradeLegNotification" (bvmf.012.01) é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, com o objetivo de informar os negócios realizados no sistema de negociação (negócio a negócio).

Uso

Esta mensagem disponibiliza detalhes dos negócios realizados pelo Participante de Negociação Pleno durante a data de movimento vigente.

Além do número de negócio e demais detalhes referentes ao instrumento capturado, a BM&FBOVESPA informará o número da alocação para cada negócio realizado. Este número será chave e deverá ser informado nos processos de repasse e alocação caso estes sejam realizados posteriormente.

Diagrama da Mensagem

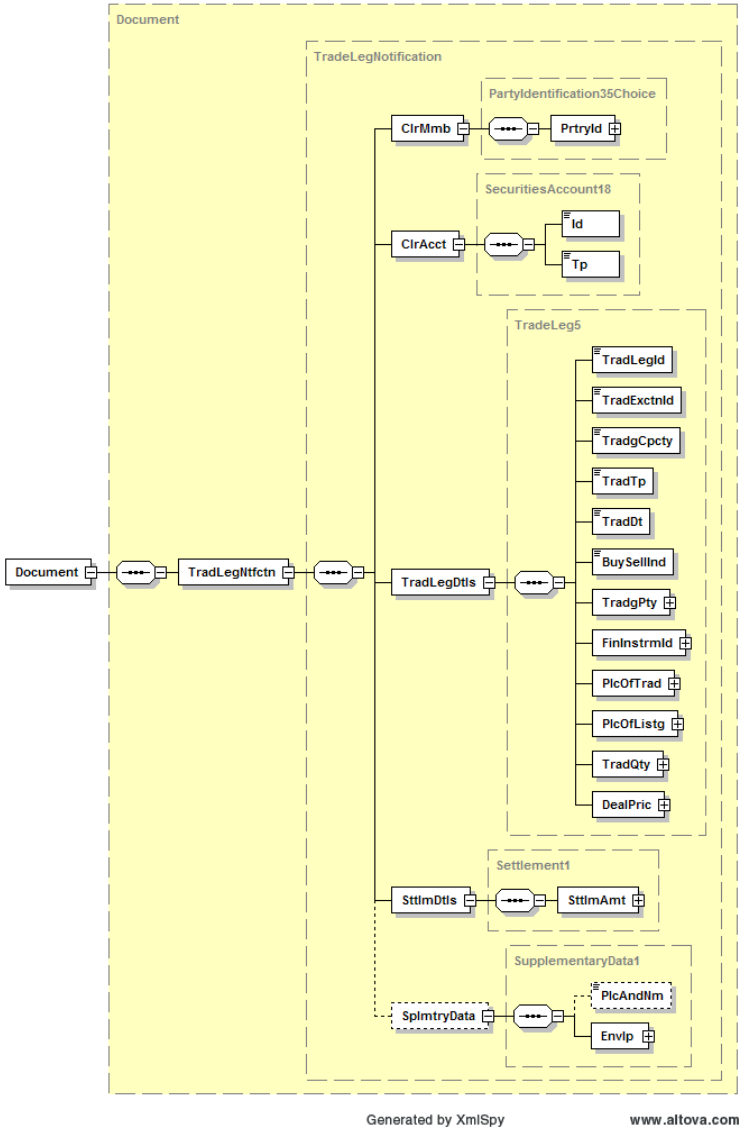
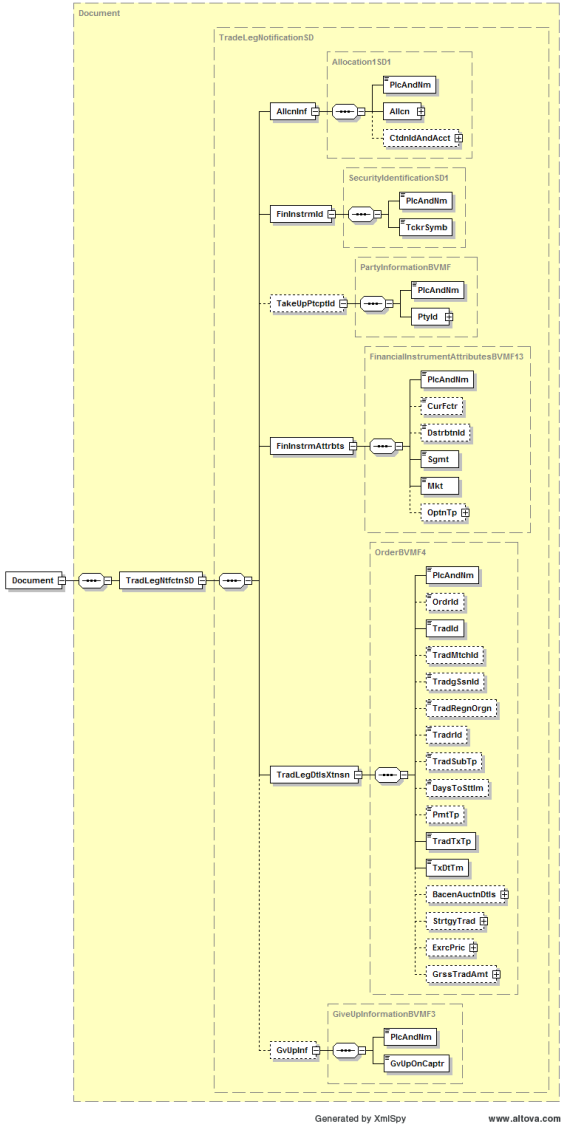

Document
TradeLegNotification
PartyIdentification35Choice
ClrMmb
PrtryId
SecuritiesAccount18
ClrAcct
Id
Tp
TradeLeg5
TradLegId
TradExctnId
TradgCpcty
TradTp
TradDt
BuySellInd
TradgPty
FinInstrmId
PlcOfTrad
PlcOfListg
TradQty
DealPric
Document
TradLegNtfctn
TradLegDtls
Settlement1
SttlmDtls
SttlmAmt
SupplementaryData1
SplmtryData
PlcAndNm
Envlp
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Diagrama da Mensagem (Supplementary Data)


Document
TradeLegNotificationSD
Allocation1SD1
PlcAndNm
AllcnInf
Allcn
CtdnIdAndAcct
SecurityIdentificationSD1
PlcAndNm
FinInstrmId
TckrSymb
PartyInformationBVMF
PlcAndNm
TakeUpPtcptId
PtyId
FinancialInstrumentAttributesBVMF13
PlcAndNm
CurFctr
DstrbtnId
FinInstrmAttrbts
Sgmt
Mkt
OptnTp
OrderBVMF4
PlcAndNm
OrdrId
TradId
TradMtchId
TradgSsnId
TradRegnOrgn
TradRld
TradSubTp
DaysToSttlm
PmtTp
TradTxTp
TxDtTm
BacenAuctnDtls
StrtgyTrad
ExrcPric
GrssTradAmt
Document
TradLegNtfctnSD
TradLegDtlsXtnsn
GiveUpInformationBVMF3
PlcAndNm
GvUpInf
GvUpOnCaptr
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1. O negócio foi realizado no sistema de negociação.

R2. Esta mensagem é disponibilizada para Participantes de Negociação Plenos executores do negócio.

R3. Os campos OrdID e TradMtchId são obrigatórios no segmento de Derivativos para operações oriundas do sistema eletrônico de negociação.

R4. Este campo somente será preenchido para equities.

Estrutura

bvmf.012.01 – TradeLegNotification

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Descrição	Description	Regra
1.0		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Este bloco identifica o Membro de Compensação do participante de negociação pleno que efetuou o negócio.	This block identifies the clearing member of the trading participant who executed the trade.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação conhecida pela instituição. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 2-123456, onde 2 significa MC (Membro de Compensação).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 2-123456, where 2 means CM (Clearing Member)	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default	

							value = 40	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39	Code of the identification type. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	
2.0		ClearingAccount	ClrAcct	[1..1]	+	Este bloco identifica a conta do investidor no participante de negociação pleno que fez o negócio. A identificação da conta precisa ser informada conforme padrão abaixo: Número da Conta. Ex: 115 = Número da Conta	This block identifies the account of the investor at the party that made the trade. The identification of the account must be informed in the standard below: Account Number. E.g 115 = Account Number	
2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. E.g 115 = Account Number	
2.2		Type	Tp	[1..1]	ClearingAccountType1Code	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = CLIE.	This field is not used by the BM & FBOVESPA. It should be filled with the default value = CLIE.	
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negócio.	This block provides details of the trade.	
3.1		TradeLegIdentification	TradLegId	[1..1]	Max35Text	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = 0.	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0.	
3.2		TradeExecutionIdentification	TradExctnId	[1..1]	Max35Text	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = 0.	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0	
3.3		TradingCapacity	TradgCpcty	[1..1]	TradingCapacity5Code	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = PRIN.	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = PRIN	
3.4		TradeType	TradTp	[1..1]	TradeType1Code	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = LKTR.	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = LKTR	
3.5		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODateTime	Fornece a data e hora do pregão.	Provides the date and time of trade transaction.	
3.6		BuySellIndicator	BuySellInd	[1..1]	Side1Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	

3.7		TradingParty	TradgPty	[1..1]	+	Código do Participante de Negociação Pleno que realizou o negócio.	Trading Participant´s ID code	
3.7.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
3.7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP(Trading Participant).	
3.7.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	
3.7.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39	Code of the identification type. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	
3.8		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.	
3.8.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor.	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	

						c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter 102arket102er automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer 102arket102er. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma 102arket102er automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle		
3.8.2		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	
3.8.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	
3.8.2.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.	
3.8.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8 (Security source)	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	
3.9		PlaceOfTrade	PlcOfTrad	[1..1]	+	Este bloco identifica o ambiente de negociação onde o negócio foi executado. Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	Place at which the security is traded. This block is not used by BM&FBOVESPA. See “Code” field in the default value of this field	
3.9.1		Type	Tp	[1..1]	+	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	This block is not used by BM&FBOVESPA. See “Code” field in the default value of this field	
3.9.1.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2 Code	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH	
3.10		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.	
3.10.1		Identification	Id	[1..1]	+	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado.	Code allocated to places of trade, ie, stock exchanges, regulated markets, eg, Electronic Trading Platforms (ECN), and unregulated markets, eg, Automated Trading Systems (ATS), as sources of prices and related information, in order to facilitate automated	

3.10.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISSO 10383 . Default = “BVMF”. (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 “Codes for exchanges and market identifications”. This tag is optional and if no Security Exchange is provided – it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = “BVMF” (SecurityExchange)	
3.10.2		Type	Tp	[1..1]	+	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	This field is not used by the BM&FBOVESPA. .	
3.10.2.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType5Code	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Preencher com o valor default = “EXCH”.	This field is not used by BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value =EXCH	
3.11		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+	Quantidade negociada.	Identifies the trade quantity.	
3.11.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantidade expressa como um valor numérico	Quantity expressed as a number.	
3.12		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Este bloco informa o valor negociado	Specifies the price	
3.12.1		Value	Val	[1..1]	+	Valor da cotação negociada.	Value of the price.	
3.12.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Valor da cotação negociada.	Value of the price.	
4.0		SettlementDetails	SttlmDtls	[1..1]	+	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	This block is not used by the BM&FBOVESPA.	
4.1		SettlementAmount	SttlmAmt	[1..1]	+	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	This block is not used by the BM&FBOVESPA.	
4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido neste campo é = 0	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0	
5.0		SupplementaryData	SplmtryData	[0..1]	+	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões	Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	

						são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISSO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.		
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem.	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.	
5.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	Technical element wrapping the supplementary data.	
5.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	

Supplementary Data

Supplementary Data – bvmf.012.01 – TradeLegNotification

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description	Regra
1.0		AllocationInformation	AllcnInf	[1..1]	+	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocação atribuído pela BM&FBOVESPA no momento da captura do negócio e a identificação da carteira (se aplicável).	This block identifies information related to the Allocation ID and finality code (if applicable).	
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctn	
1.2		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Informações de alocação.	Allocation reference.	
1.2.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID provided by BM&FBOVESPA	
1.2.2		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identificação da carteira na depositária.	Identification of the sub account.	

1.3		CustodianIdentificationAndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+	Este bloco contém a identificação do Agente de Custodia e da conta de custódia, caso a conta capturada possua vínculo de custódia previamente registrada.	This block identifies the Custodian ID code and theCustodian Account ID code if the position account captured has a custodian link previously registered.	
1.3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Fornece detalhes de identificação do participante.	Provides details about the party identification.	
1.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
1.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 1-123456, onde 1 significa Agente de Custodia.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 1-123456, where 1 means CST (Custodian)	
1.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	
1.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	
1.3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Fornece dados de identificação da conta.	Provides account identification	

1.3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	
1.3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.	
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	
2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam uma ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	
3.0		TakeUpParticipantIdentification	TakeUpPtcptId	[0..1]	+	Este bloco identifica o participante destino no caso em que a conta capturada já tiver um vínculo de repasse.	This block identifies the party destination (Take Up) if the account has already captured a link give up with another account.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	
3.2		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação do participante destino do repasse.	This block identifies the take up participant.	
3.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible	

						feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	
3.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	
3.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	
4.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Este bloco contém infomações relacionadas aos dados de instrumento que não foram contempladas pela mensagem ISO.	Elements characterising a financial instrument.	
4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	
4.2		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Fator de cotação do instrumento.	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	
4.3		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Número de distribuição do papel.	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	
4.4		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds	

						4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.5		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.6		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Este bloco identifica se o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente).	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	

4.6.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	
5.0		TradeLegDetailsExtension	TradLegDtlsXtnsn	[1..1]	+	Este bloco contém infomações relacionadas ao negócio que não foram contempladas pela mensagem ISO.	Details of the trade.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn/TradLegDtls	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is xPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctn/TradLegDtls	
5.2		OrderIdentification	OrdrId	[0..1]	Max26Text	Número da ordem no sistema eletrônico.	Unique identifier for Order assigned by the trading system.	R3
5.3		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.	
5.4		TradeMatchIdentification	TradMtchId	[0..1]	Max10Text	Número de negócio no sistema eletrônico.	Trade identification assigned by the trading system.	R3
5.5		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indicates if the trade has been done on regular or non regular trade (after market). This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	R4
5.6		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
5.7		TraderIdentification	TradrId	[0..1]	Max50Text	Este campo informa o código do operador.	Indicates the trader code.	

5.8		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex.: 37 Cross trade 43 Auction Trade 1000 Trade was inserted by market ops on-behalf of firm 1001 Termo Vista 1002 Termo Vista Registered	Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls Eg 37 Cross trade 43 Auction Trade 1000 Trade was inserted by market ops on-behalf of firm 1001 Termo Vista 1002 Termo Vista Registered	
5.9		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	Prazo em dias para a liquidação do contrato a termo (em ações).	Indicates number of days settlement in a forward´s contract (equities).	
5.10		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. Ex.: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	This field identifies the settlement type . This filed requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	

5.11		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Specifies the type of transaction of which the order is a component. This filed requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.12		TransactionDateTime	TxDtTm	[1..1]	ISODateTime	Fornece a Date e hora da execução do negócio.	Provides the date and time execution/order creation.	
5.13		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN..	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	
5.13.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctnId	[0..1]	Max8Text	Número do comunicado BACEN.	BACEN´s communication number.	
5.13.2		AuctionProposalIdentification	AuctnPrpslId	[0..1]	Max6Text	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	Auction Proposal Number.	
5.13.3		SelicAccountIdentification	SelicAcctId	[0..1]	Max9NumericText	Identifica a Conta Selic.	Selic Account ID.	
5.13.4		StartPositionDate	StartPosDt	[0..1]	+	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	Start position date of the dollar swap trade.	
5.13.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.	
5.14		StrategyTrade	StrtgyTrad	[0..1]	+	Contém dados de estratégia.	Strategy information.	
5.14.1		ShortFuturePrice	ShrtFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Valor futuro curto.	Short leg price.	
5.14.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Valor futuro longo.	Long leg price.	
5.14.3		Delta	Dlta	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7Decima	Valor do Delta.	Delta value.	

					lAmount			
5.15		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Este bloco informa o preço de exercício da opção.	This block informs the strike of an option trade.	
5.15.1		Value	Val	[1..1]	+	Possui um valor financeiro ligado a uma ordem ou instrumento.	Value of the price.	
5.15.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Valor expresso em valor e moeda.	Price expressed as a currency and value.	
5.16		GrossTradeAmount	GrssTradAmt	[0..1]	+	Este bloco informa o volume negociado.	This block informs the gross trade amount.	
5.16.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	Volume negociado.	Gross amount of money.	
6.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..1]	+	Este bloco informa se a conta capturada possui vinculo de repasse.	This block informs if the captured account has a give-up link.	
6.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	
6.2		GiveUpOnCapture	GvUpOnCaptr	[1..1]	YesNoIndicator	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	

bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar a inclusão de conta de comitente e demais informações necessárias para fins de liquidação (alocação).

Uso

Esta mensagem é utilizada para identificar o comitente final do negócio, indicar uma conta máster, realizar repasse e incluir demais informações necessárias para fins de liquidação, como indicação de Agente de Custódia para entrega ou recebimento de ativos e sub-conta (carteira), quando aplicável.

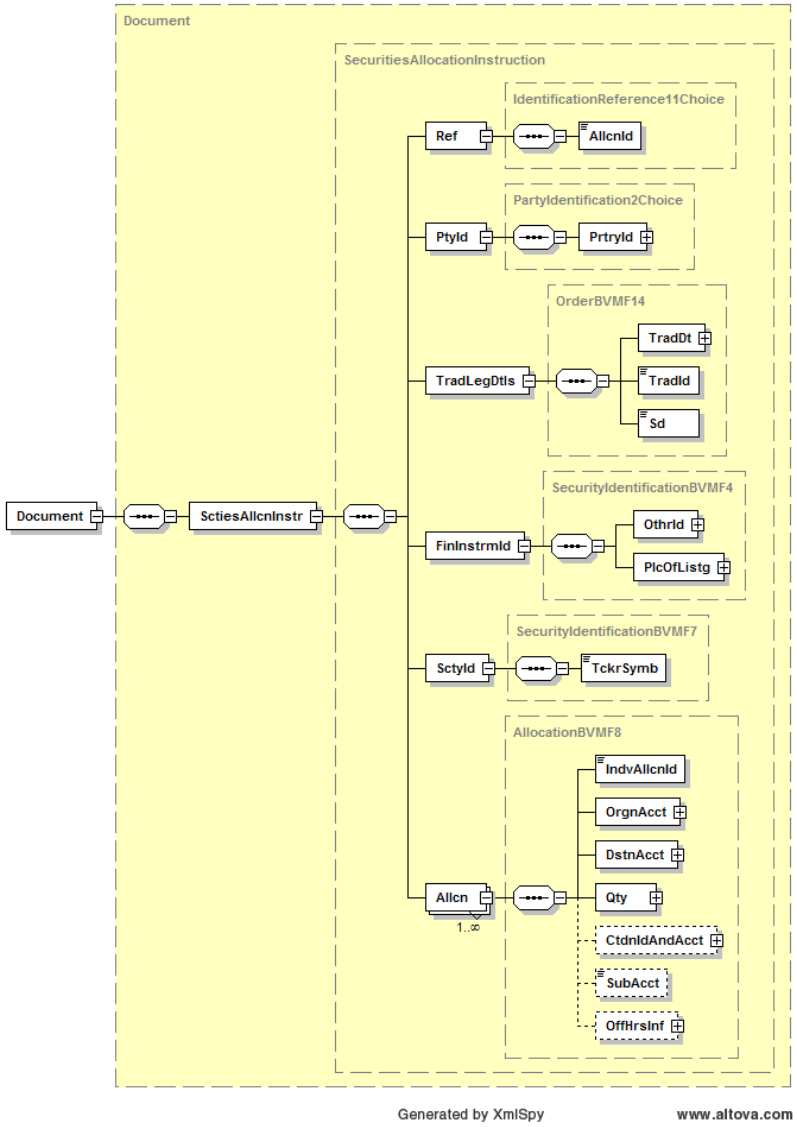
O tratamento da mensagem bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction será realizada de forma incremental, ou seja, para um mesmo negócio, novas alocações deverão ser realizadas somente para a quantidade, seja parcial ou total, em que se deseja incluir uma conta. Caso seja uma quantidade parcial, a quantidade remanescente permanecerá inalterada, podendo esta ser alterada em outro momento.

Deverão ser informados na mensagem bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction, além dos atributos convencionais, os seguintes atributos:

- Número de alocação (Allocation Identification) – conforme numero informado pela BM&FBOVESPA, seja através de mensagem de captura de negócio (bvmf.012.01 – TradeLegNotification) ou mensagem de retorno de alocação anterior.
- Número individual de alocação (IndividualAllocationID) - para identificação de cada grupo de repetição (no caso de alocações parciais), permitindo o controle das respostas de suas requisições de alocação e repasse. É um identificador atribuído e controlado pelo participante, que receberá na mensagem de retorno da alocação (bvmf.014.01 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice) o mesmo número individual de alocação informado na solicitação de alocação.

A mensagem bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction representa a alocação a partir de um único número de alocação.

Diagrama da Mensagem


Document
SecuritiesAllocationInstruction
IdentificationReference11Choice
Ref
AllcnId
PartyIdentification2Choice
PtyId
PrtryId
OrderBVMF14
TradDt
TradLegDtls
TradId
Sd
SecurityIdentificationBVMF4
Document
SctiesAllcnInstr
FinInstrmId
OthrId
PlcOfListg
SecurityIdentificationBVMF7
SctyId
TckrSymb
AllocationBVMF8
IndvAllcnId
OrgnAcct
DstnAcct
Allcn
Qty
1..∞
CtdnIdAndAcct
SubAcct
OffHrsInf
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1. O negócio já foi capturado do sistema de negociação para o sistema de alocação.

Estrutura

bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description
1.0		Reference	Ref	[1..1]	+	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocação	This block contains the allocation Identification
1.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da alocação Anteriormente atribuído pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID number. Previously provided by BM&FBOVESPA.
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identifica o Participante requisitante da inclusão de alocação.	Identifies the Participant who is requesting the allocation inclusion.
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40

2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negocio.	This block provides details of the trade.
3.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Fornece a data do pregão.	Provides the trade date.
3.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.
3.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.
3.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.
4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).
4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.
4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).
4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.
4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)
5.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	Este bloco contem informações do código de negociação.	This block contains the Ticker Symbol.

5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3
6.0		Allocation	Allcn	[1..*]	+	Este bloco especifica informações da alocação	Allocation information
6.1		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.
6.2		OriginAccount	OrgnAcct	[1..1]	+	Este bloco identifica a conta em que o negócio está atualmente alocado.	This block identifies the account in which trade is allocated.
6.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number
6.3		DestinationAccount	DstnAcct	[1..1]	+	Identificação da conta que irá receber a quantidade alocada por essa mensagem.	Account identification that will receive the amount allocated for this message.
6.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number
6.4		Quantity	Qty	[1..1]	+	Especifica a quantidade destinada à alocação.	Specifies the trade quantity to be allocated.
6.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantidade expressa em um valor numérico.	Quantity expressed as a number.
6.5		CustodianIdentificationAndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+	Este bloco contém o código de identificação do Agente de Custódia e o código da conta de custódia.	This block identifies the custodian ID and the custodian account ID
6.5.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Fornece detalhes de identificação do participante.	Provides details about the party identification.

6.5.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.
6.5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 1-123456, onde 1 significa CST (Agente de Custódia).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 1-123456, where 1 means CST (Custodian).
6.5.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40
6.5.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.
6.5.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Este bloco contém o código de conta no Agente de Custódia	This block contain the custodian account identification
6.5.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.5.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Código de conta no Agente de Custódia Ex: 115 = Número da Conta	Custodian account ID E.g 115 = Account Number
6.6		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identificação da carteira na depositária..	Identification of the sub account.
6.7		OffHoursInformation	OffHrsInf	[0..1]	+	Este bloco indica se houve quebra de regra no caso de uma solicitação de alocação ou repasse enviado após o horário limite.	Indicates an allocation or give-up being requested after the allocation time limits

6.7.1		OffHoursDelayResponsibility	OffHrsDelyRspnsblty	[0..1]	ExternalOffHoursDelayResponsibilityCode	Para o caso de indicação de repasse, informa o participante responsável pelo repasse realizado fora do prazo limite (quebra de regra), Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	In case of give-up, this field informs the participant responsible for the delay (off-hour request). This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls
6.7.2		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indica se é uma alocação sendo solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	Indicates if it is an off-hour allocation request
6.7.3		OffHoursReason	OffHrsRsn	[1..1]	ExternalOffHoursReasonCode	Apresenta a justificativa para a alocação ou repasse realizado fora do horário (quebra de regra) Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursReasonCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	Specifies the reason for requesting a give-up or allocation after the time limits. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursReasonCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls

bvmf.014.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice é enviada pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com o intuito de informar a situação da alocação, exclusão de alocação, situação final de repasse efetuado e atualização de preços/ajuste dos negócios de Integralização/resgate de ETF realizadas no mercado Primário (neste último caso, quando houver repasse envolvido).

Uso

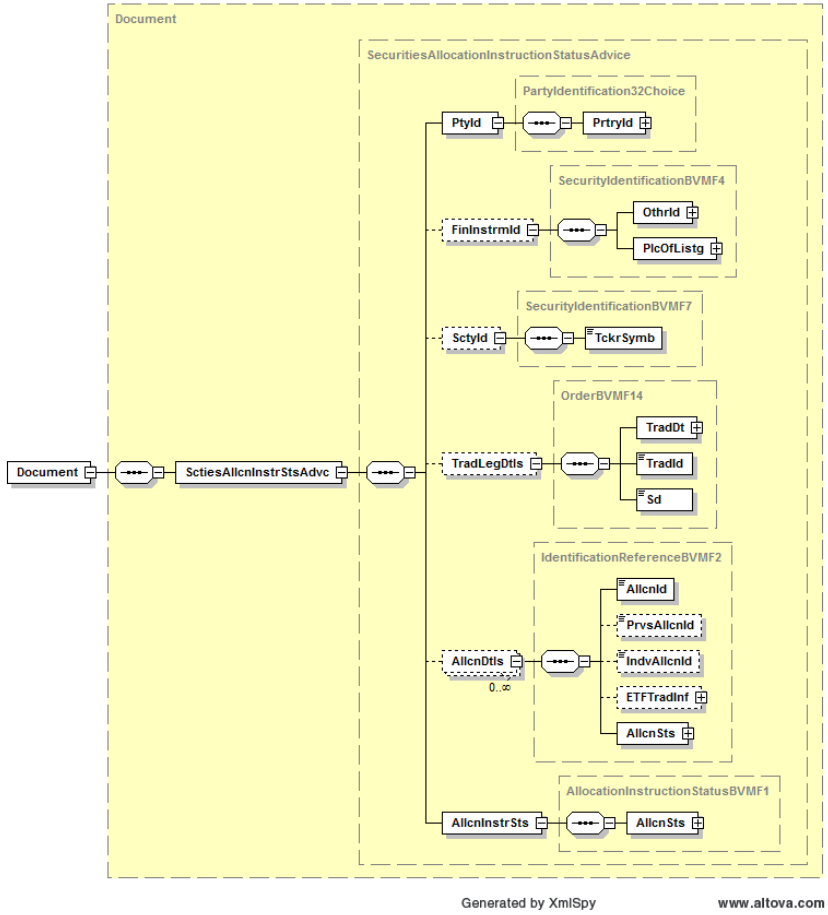
Esta mensagem informa os participantes a situação de uma requisição de inclusão de alocação, exclusão de alocação, status final de repasse realizado e atualização de preços/ajuste de ETF Primário.

O número de alocação *(Allocation Identification)* informado na mensagem de status de alocação bvmf.014.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice pode ser diferente do número de alocação enviado na mensagem de estímulo (requisição), desta forma, é imprescindível o tratamento do número de alocação informado da mensagem de resposta para posteriores (re) alocações e repasses.

O número individual de alocação (IndividualAllocationID) informado na mensagem de status de alocação bvmf.014.02– SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice será o mesmo informado em cada grupo de repetição enviado na mensagem de estímulo bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction.

O número de alocação anterior (*PreviousAllocationID*), quando informado, identificará o número de alocação prévio que foi substituído pelo novo número de alocação gerado (AllocationIdentification) pela BM&FBOVESPA.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1. Os campos deste bloco somente serão preenchidos para informar atualização de preço/ajuste em negócios de ETF Primário.

Estrutura

bvmf.014.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block identifies the participant who will receive the "Status Advice" message.	Este bloco identifica o participante que receberá a mensagem "Status Advice".	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[0..1]	+	Provides details about the security identification	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	

2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.0		SecurityIdentification	SctyId	[0..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contem informações do Ticker Symbol.	
3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[0..1]	+	This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	

5.0		AllocationDetails	AllcnDtls	[0..*]	+	This block contains references to the control numbers assigned by the participant for each allocation requested in the message and the numbers attributed to each allocation by BM&FBOVESPA.	Este bloco contém as referências dos números de controle atribuídos pelo participante para cada alocação solicitada e os números de cada alocação atribuídos pela BM&FBOVESPA.	
5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number. Provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação. Atribuído pela BM&FBOVESPA.	
5.2		PreviousAllocationIdentification	PrvsAllcnId	[0..1]	Max35Text	Identifies the previous AllocationID known by the BM&FBOVESPA .	Identifica o número de controle da alocação anterior, fornecido pela BM&FBOVESPA .	
5.3		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[0..1]	Max35Text	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and this allocation status response.	Número individual de alocação. Esse número foi atribuído pelo sistema do participante que enviou a mensagem de requisição, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e esta mensagem de situação de alocação	
5.4		ETFTradeInformation	ETFTradInf	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados de negociação do trade de ETF.	R1
5.4.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
5.4.2		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
5.4.3		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
5.4.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Specifies the price.	Este bloco informa o valor negociado.	

5.4.4.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
5.4.4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
5.4.5		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
5.5		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	This structure provides the status and/or the error of each processing allocations or final give-up status.	Essa estrutura identifica a situação e/ou o erro de cada processamento das alocações e situação final de repasse.	
5.5.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
5.5.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.5.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	

5.5.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
6.0		AllocationInstructionStatus	AllcnInstrSts	[1..1]	+	This block contains the allocation status of the request and/or the error found in the request.	Este bloco contém a situação da solicitação de alocação e/ou o erro encontrado para a solicitação.	
6.1		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	This block identifies the allocation status request.	Este bloco identifica a situação da solicitação de alocação.	
6.1.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
6.1.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalAllocationInstructionStatus in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalAllocationInstructionStatus localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
6.1.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
6.1.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	

bvmf.015.01 - SecuritiesAllocationInstructionCancellation

Funcionalidade da Mensagem

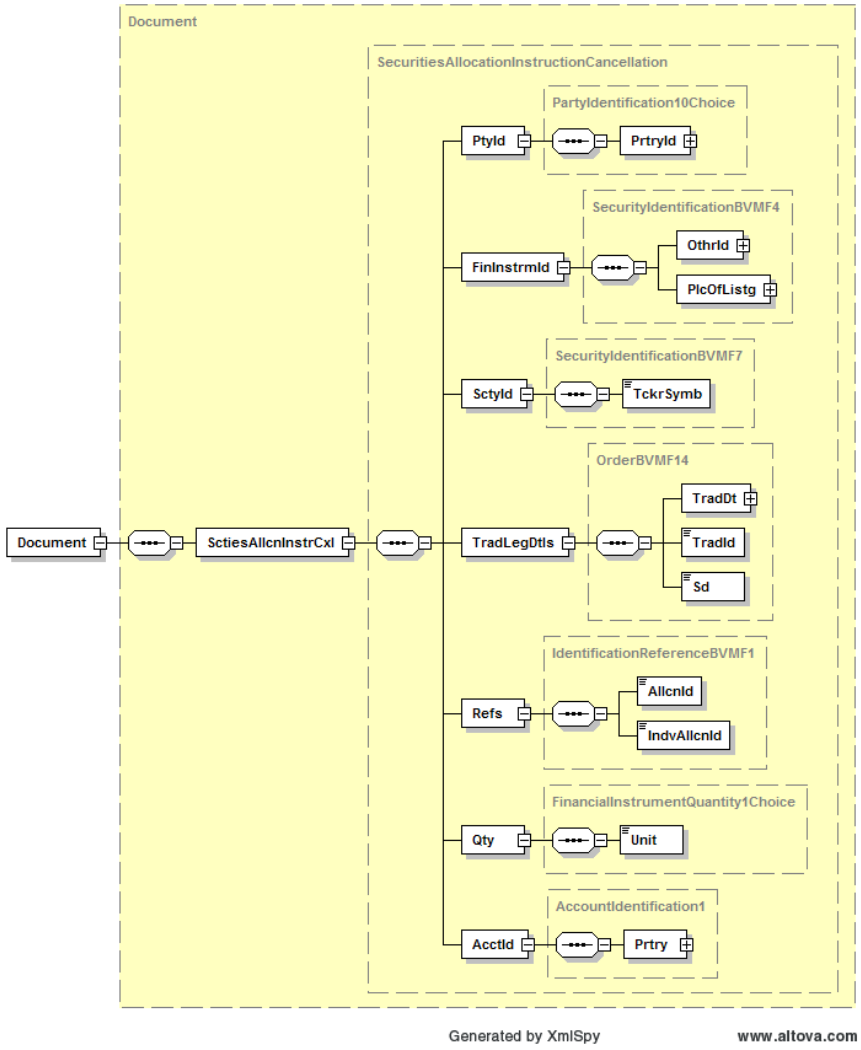
Escopo

A mensagem SecuritiesAllocationInstructionCancellation é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar a exclusão da conta de comitente previamente alocada no negócio.

Uso

Esta mensagem permite a exclusão da alocação previamente realizada.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1. Os pedidos de exclusão de alocação são sujeitos à análise de risco.

Estrutura

bvmf.015.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Participante que solicita o cancelamento da alocação.	Participant who is submitting the allocation exclusion.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.	
2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	

2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	
2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	
2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.	
2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	
3.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	Este bloco contem informações do código de negociação.	This block contains the Ticker Symbol.	
3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	
4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negócio.	This block provides details of the trade.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Fornece a data do pregão.	Provides the trade date.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	
5.0		References	Refs	[1..1]	+	Este bloco identifica o número de alocação atribuído pela BM&FBOVESPA e número de alocação individual atribuído pelo participante.	This block identifies the allocation identification assigned by the BM&FBOVESPA and the individual allocation identification assigned by the participant.	
5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de controle da alocação. Provido pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID. Provided by BM&FBOVESPA.	

5.2		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	
6.0		Quantity	Qty	[1..1]	+	Especifica a quantidade a ser excluída da alocação.	Quantity to be excluded.	
6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantidade expressa como um valor numérico.	Quantity expressed as a number.	
7.0		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Identificação da conta a ser excluída da alocação.	Account ID to be excluded.	
7.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	
7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	

bvmf.016.01 – ResponseGiveUpAcceptanceorRejection

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection é enviada pelo participante à BM&FBOVESPA com o objetivo de aceitar/rejeitar um repasse (Destino), solicitar um cancelamento de repasse (Destino) ou aprovar/rejeitar um cancelamento de repasse (Origem).

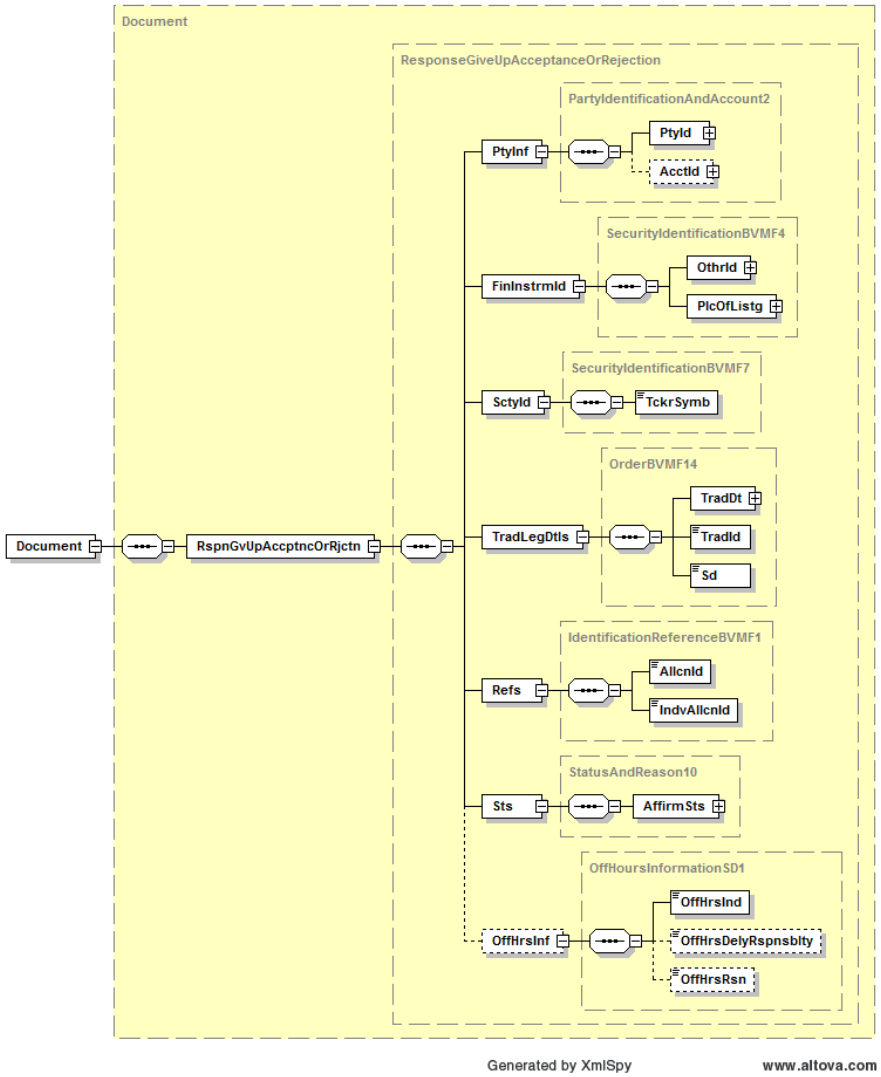
O termo cancelamento de repasse é utilizado quando há uma solicitação de rejeição de repasse enviada fora da grade.

Uso

O Participante Destino envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection à BM&FBOVESPA para (i) aceitar/rejeitar um repasse pendente de sua aprovação ou rejeitá-lo caso previamente aprovado e ainda dentro da grade, ou (ii) solicitar um cancelamento de repasse.

O Participante Origem envia a mensagem ResponseGiveUpAcceptanceorRejection à BM&FBOVESPA para (i) aceitar/rejeitar um cancelamento de repasse pendente de sua aprovação.

Diagrama da Mensagem


Document
ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection
PartyIdentificationAndAccount2
PtyId
AcctId
PtyInf
SecurityIdentificationBVMF4
OthrId
PlcOfListg
FinInstrmId
SecurityIdentificationBVMF7
TckrSymb
SctyId
OrderBVMF14
TradDt
TradId
Sd
TradLegDtls
Document
RspnGvUpAccptncOrRjctn
IdentificationReferenceBVMF1
AllcnId
IndvAllcnId
Refs
StatusAndReason10
AffirmSts
Sts
OffHoursInformationSD1
OffHrsInd
OffHrsDelyRspnsblty
OffHrsRsn
OffHrsInf
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1: O preenchimento do campo AccountIdentification (AccID) é obrigatório nas situações descritas abaixo:
- Solicitação de rejeição de repasse pelo Participante Destino, de um repasse em situação já aprovado (status do repasse : 4-Give up approved), solicitado dentro ou fora da grade de confirmação do repasse

O preenchimento do campo AccountIdentification (AccID) NÃO é requerido nos demais casos:- Solicitação de aceitação/rejeição de repasse pelo Participante Destino cujo repasse esteja em situação pendente de confirmação (status do repasse :3-Pending Give up approval).
- Solicitação de aceitação/rejeição de cancelamento de repasse pelo Participante Origem cujo cancelamento de repasse esteja em situação pendente de confirmação (status do repasse: 8-Pending Take up cancellation approval).

R2. Existe negócio com *status* Pendente de Aceitação/Rejeição de repasse para o Participante Destino ou *status* Pendente de Aceitação/Rejeição de cancelamento de repasse para o Participante Origem.

R3. É possível rejeitar um negócio já acatado, seguindo as regras de grade.

R4. A indicação yes (true) do campo OffHoursIndicator (OffHrsInd) é obrigatório quando envolver um cancelamento de repasse (rejeição fora da grade):
- na solicitação de cancelamento de repasse enviada pelo participante destino.
- na aceitação/rejeição de um cancelamento de repasse enviada pelo participante origem.

Este campo não deve ser preenchido para os demais casos envolvendo o uso desta mensagem:
- aceitação ou rejeição de repasse requisitado dentro ou fora da grade (confirmação enviada pelo participante destino).

R5. O preenchimento deste campo é obrigatório no caso de requisição de cancelamento de repasse (rejeição fora do horário) enviada pelo participante destino do repasse.
Este campo não deve ser preenchido nos demais casos de uso desta mensagem:

- aceitação ou rejeição de repasse enviado dentro ou fora da grade (enviada pelo participante destino)
- aceitação ou rejeição de cancelamento de repasse (enviada pelo participante origem).

Estrutura

bvmf.016.01 – ResponseGiveUpAcceptanceorRejection

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description	Regra
1.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Este bloco identifica o participante que está aceitando, ou rejeitando a uma mensagem do tipo "bvmf.019.01 - InformGiveUpPendingApproval" .	This block identifies the participant and account who is accepting or rejecting the "bvmf.019.01 - InformGiveUpPendingApproval" message.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Fornece detalhes de identificação do participante.	Provides details about the party identification.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	
1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	

1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Fornece dados de identificação da conta.	Provides the account identification.	
1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	R1
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.	
2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	
2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	
2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.	
2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	
3.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	Este bloco contem informações do código de negociação.	This block contains the Ticker Symbol.	
3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	

4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negócio.	This block provides details of the trade.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Especifica uma data.	Specified date.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	
5.0		References	Refs	[1..1]	+	Este bloco identifica o número de alocação atribuído pela BM&FBOVESPA e número de alocação individual atribuído pelo participante.	This block identifies the allocation identification assigned by the BM&FBOVESPA and the individual allocation identification assigned by the participant.	
5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de controle da alocação. Provido pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID. Provided by BM&FBOVESPA.	
5.2		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	
6.0		Status	Sts	[1..1]	+	Este bloco contém os detalhes da situação do repasse. O participante destino informa o aceite ou Rejeite do repasse.	This block allows the give-up acceptance or rejection (confirmation).	
6.1		AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+	Confirmação do repasse.Permite a aceitação ou rejeição do repasse.	Give-up confirmation. Allows the acceptance or rejection of a give-up.	
6.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmationStatus1Code	Confirmação de repasse. Ex: AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	Give-up confirmation. Ex: AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	

7.0		OffHoursInformation	OffHrsInf	[0..1]	+	Este bloco **deve ser** utilizado somente para situações que envolvem cancelamento de repasse (rejeição fora da grade): (i)pelo participante destino, ao enviar uma solicitação de cancelamento de repasse, com a utilização dos campos 7.1, 7.2 e 7.3; (ii) pelo participante origem, ao aceitar ou rejeitar a solicitação de cancelamento de repasse (utilização apenas do campo 7.1). Este bloco não deve ser utilizado para os demais casos envolvendo o uso desta mensagem: aceitação/rejeição, pelo participante destino,de um repasse enviado dentro da grade ou fora da grade.	This block **must be** used only for the cases involving take-up cancellation (takeup rejection req. off-hour) : (i) By the take-up participant,, when sending a take-up cancellation request (fields 7.1, 7.2, 7.3) (ii)By the give-up participant, when accepting/rejecting the take-up cancellation request (field 7.1 only). This block **should not** be filled in when sending an acceptance/rejection of a take-up (as response of an on-hour or off-hour give-up request)	
7.1		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indica solicitação de cancelamento de repasse (pelo Destino) ou aceitação/rejeição de um cancelamento de repasse (pelo Origem). Este campo **deve ser** obrigatoriamente indicado yes (true) nos casos de: - solicitação de cancelamento de repasse (rejeição fora da grade) enviada pelo participante destino. - aceitação/rejeição de um cancelamento de repasse (rejeição fora da grade) enviada pelo participante origem. Este campo **não deve** ser preenchido para os demais casos envolvendo o uso desta mensagem: - aceitação ou rejeição de repasse requisitado dentro ou fora da grade (confirmação enviada pelo participante destino).	Indicates a takeup cancellation request or takeup cancellation acceptance/rejection. This field **must be mandatorily** indicated: (i) By the take-up participant,, when sending a take-up cancellation request (off-hour) (ii)By the give-up participant, when accepting/rejecting a take-up cancellation request (off-hour). This field **must not be** filled in when sending an acceptance/rejection of a take-up (response of an on-hour or off-hour give-up request)	R4
7.2		OffHoursDelayResponsibility	OffHrsDelyRspnsblty	[0..1]	ExternalOffHoursDelayResponsibilityCode	Este campo informa o participante responsável pelo atraso (faltante). Este campo **deve ser obrigatoriamente** preenchido somente no caso de requisição de cancelamento de repasse (rejeição fora do horário) enviada pelo participante destino do repasse.	Informs the participant responsible for the delay. This field **is mandatory** only in case of take-up cancellation request This field **must not be** filled in for all the other situations where this message is used for: (i)acceptance/rejection of a take-up,	R5

						Este campo **não deve ser** preenchido nos casos de uso desta mensagem: (i) aceitação ou rejeição de repasse enviado dentro ou fora da grade (confirmação enviada pelo participante destino); (ii) aceitação ou rejeição de cancelamento de repasse (rejeição repasse enviado fora da grade - confirmação enviada pelo participante origem). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	requested on-hour or off-hour ,OR; (ii)acceptance/rejection of a take-up cancellation. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
7.3		OffHoursReason	OffHrsRsn	[0..1]	ExternalOffHours ReasonCode	Especifica a justificativa para o atraso. Este campo **deve ser obrigatoriamente** preenchido somente no caso de requisição de cancelamento de repasse (rejeição fora do horário) enviada pelo participante destino do repasse. Este campo **não deve ser** preenchido nos demais casos de uso desta mensagem: (i) aceitação ou rejeição de repasse enviado dentro ou fora da grade (confirmação enviada pelo participante destino); (ii) aceitação ou rejeição de cancelamento de repasse (rejeição repasse enviado fora da grade) confirmação enviada pelo participante origem). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursReasonCode no arquivo	Informs the delay reason. This field **is mandatory** only in case of take-up cancellation request. This field **must not be** filled in for all the other situations where this message is used for: (i)acceptance/rejection of a take-up requested on-hour or off-hour ,OR; (ii)acceptance/rejection of a take-up cancellation. This field requires an external code list.Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursReasonCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	R5

						ExternalCodeLists_BVMF.xls.		

bvmf.017.02 – TradeLegNotificationCancellation

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem TradeLegNotificationCancellation é enviada pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno (comprador e vendedor) informando o cancelamento de determinado negócio no sistema de negociação e também em caso de cancelamento de negócios de ETF Primário. Caso a operação tenha sido repassada, esta mensagem é enviada aos participantes origem e destino do repasse.

Uso

Esta mensagem informa a todos os participantes envolvidos no fluxo, o cancelamento de negócio no sistema de negociação.

Diagrama da Mensagem

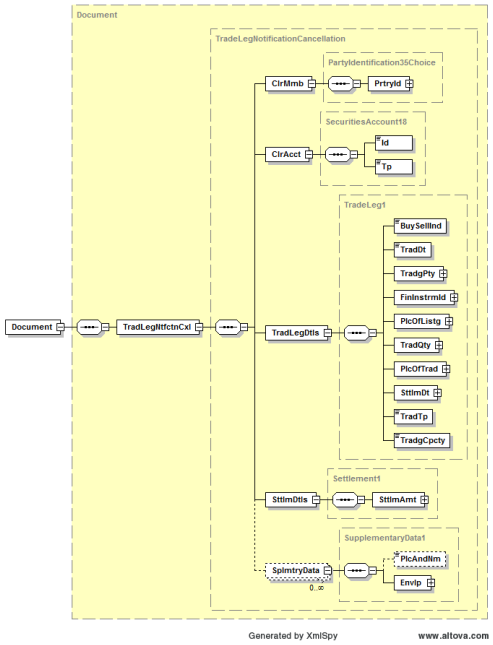
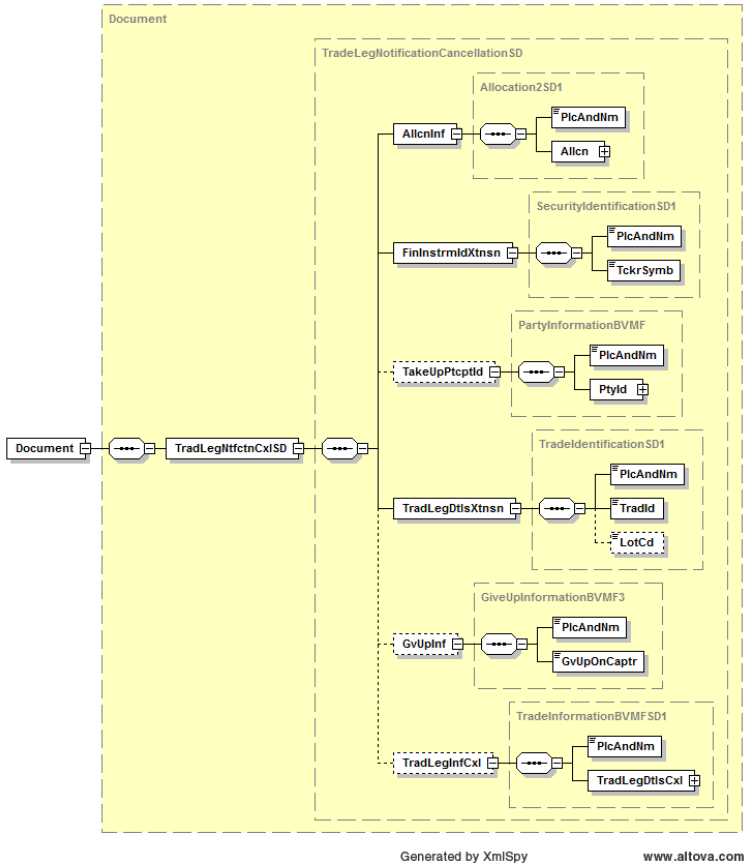

Document
TradeLegNotificationCancellation
PartyIdentification35Choice
ClrMmb
PrtryId
SecuritiesAccount18
ClrAcct
Id
Tp
TradeLeg1
BuySellInd
TradDt
TradgPty
FinInstrmId
PlcOfListg
TradQty
PlcOfTrad
SttlmDt
TradTp
TradgCpcty
Settlement1
SttlmDtls
SttlmAmt
SupplementaryData1
SplmtryData
0..∞
PlcAndNm
Envlp
Document
TradLegNtfctnCxl
TradLegDtls
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Diagrama da Mensagem (Supplementary Data)



Regras

R1. Esta mensagem informará negócios cancelados em D+0 e em D+1.

R2. Os campos deste bloco somente serão preenchidos em caso de cancelamento de negócios de ETF Primário.

Estrutura

bvmf.017.02 – TradeLegNotificationCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	This block identifies the clearing member of the participant who is receiving the message.	Este bloco identifica o membro de compensação do participante que está recebendo a mensagem.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		ClearingAccount	ClrAcct	[1..1]	+	This block is not used by BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	

2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number.	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta.	
2.2		Type	Tp	[1..1]	ClearingAccountType1Code	This field is not used by the BM& FBOVESPA. It should be filled with the default value = CLIE.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = CLIE.	
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
3.1		BuySellIndicator	BuySellInd	[1..1]	Side1Code	Identifies the trade leg indicator which gives the trade side (buy or sell).	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
3.2		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODateTime	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
3.3		TradingParty	TradgPty	[1..1]	+	Provides the identification of the trading party.	Identificação do código do participante.	
3.3.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.3.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este	

						This field should be filled with default value = 39.	campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.4		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
3.4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	
3.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
3.4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
3.5		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Place at which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.5.1		Identification	Id	[1..1]	+	Code allocated to places of trade, ie, stock exchanges, regulated markets, eg, Electronic Trading Platforms (ECN), and unregulated markets, eg, Automated Trading Systems (ATS), as sources of prices and related information, in order to facilitate automated processing.	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado.	
3.5.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.5.2		Type	Tp	[1..1]	+	This field is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
3.5.2.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType5Code	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It must be filled with the Default Value = EXCH.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido deve ser igual a "EXCH".	
3.6		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+	Identifies the cancelled quantity.	Quantidade negociada.	
3.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.7		PlaceOfTrade	PlcOfTrad	[1..1]	+	This field is not used by the BM&FBOVESPA. The default content of this field is defined in the Code field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	

3.7.1		Type	Tp	[1..1]	+	This block is not used by BM&FBOVESPA. See “Code” field in the default value of this field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	
3.7.1.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2Code	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH.	
3.8		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 1900-01-01	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido está definido no campo abaixo. com o valor 1900-01-01.	
3.8.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.9		TradeType	TradTp	[1..1]	TradeType1Code	Identifies the type of trade transaction.	Identifica o tipo da transação negociada.	
3.10		TradingCapacity	TradgCpcty	[1..1]	TradingCapacity5Code	Identifies the trading capacity of seller.	Identifica a capacidade comercial do vendedor.	
4.0		SettlementDetails	SttlmDtls	[1..1]	+	This field is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
4.1		SettlementAmount	SttlmAmt	[1..1]	+	This block is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
5.0		Supplementary Data	SplmtryData	[0..*]	+	Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
5.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+	Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	

5.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+	Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	

Supplementary Data - SUPL.017.02 – TradeLegNotificationCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		AllocationInformation	AllcnInf	[1..1]	+	This block refersto the AllocationId assigned by BM&FBOVESPA.	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é xPath para o elemneto que está sendo extendido //Document/TradLegNtfctnCxl	
1.2		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Allocation reference.	Informações de alocação.	
1.2.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
2.0		FinancialInstrumentIdentificationExtension	FinInstrmIdXtnsn	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls/FinInstrmId	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls/FinInstrmId	

2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
3.0		TakeUpParticipantIdentification	TakeUpPtcptId	[0..1]	+	This block identifies the Take Up participant in case give up.	Este bloco identifica o participante destino no caso de repasse.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
3.2		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block identifies the take-up participant ID code.		
3.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este	

						This field should be filled with default value = 39.	campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		TradeLegDetailsExtension	TradLegDtlsXtnsn	[1..1]	+	This block contains information related to the trade that was not covered by ISO message.	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio que não foram contempladas pela mensagem ISO.	R2
4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
4.3		LotCode	LotCd	[0..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
5.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..1]	+	GiveUp details.	Este bloco contém informações de repasse do negócio.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
5.2		GiveUpOnCapture	GvUpOnCaptr	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	
6.0		TradeLegInformationCancellation	TradLegInfCxl	[0..1]	+	Block with the cancellation of trade information.	Bloco com informações do cancelamento do negócio.	
6.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
6.2		TradeLegDetailsCancellation	TradLegDtlsCxl	[1..1]	+	Block with the details of trade information.	Bloco com detalhes do cancelamento do negócio.	
6.2.1		TradeCancellationDateTime	TradCxlDtTm	[1..1]	ISODateTime	Trade Cancellation Date and Time	Informa a data e hora da realização do cancelamento.	
6.2.2		TradeRemaini	TradRmng	[0..1]	DecimalNumber	Remaining Quantity of the trade.	Indica a quantidade remanescente após o	

		ngQuantity	Qty				cancelamento.	
6.2.3		CancellationJustification	CxlJustfn	[0..1]	Max35Text	Inform the cancellation of the trade justification.	Informa a justificativa do cancelamento do negócio.	

bvmf.019.02 – InformGiveUpPendingApproval

Funcionalidade da Mensagem

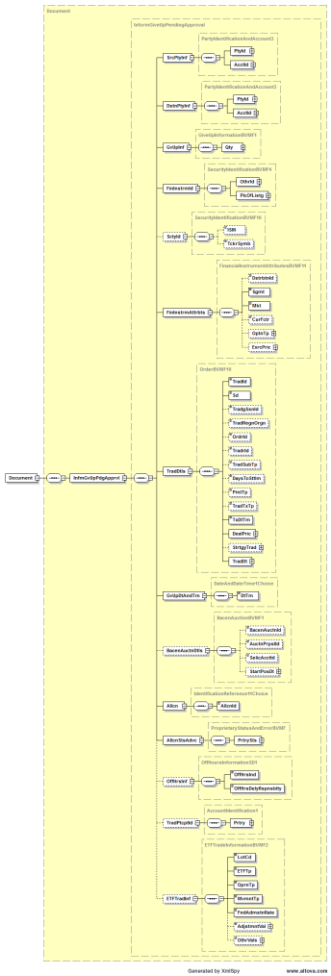
Escopo

A mensagem InformGiveUpPendingApproval é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante Destino ou Origem informando os detalhes de negócios cuja situação é Pendente de Aceitação/Rejeição de repasse ou cancelamento de repasse.

Uso

Esta mensagem informa aos Participantes a existência de negócios pendentes de aprovação ou rejeição de repasse ou cancelamento de repasse.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1. Os negócios foram recebidos através de repasse e estão aguardando a aceitação ou rejeição do Participante Destino ou Origem (este último, no caso de cancelamento de repasse fora da grade solicitado pelo Participante Destino).

R2. Este campo somente será preenchido para equities.

R3. Os campos deste bloco somente serão preenchidos para negócios de ETF Primário.

Estrutura

bvmf.019.02 – InformGiveUpPendingApproval

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		SourcePartyInformation	SrcPtyInf	[1..1]	+	This block contains information of the give-up participant and give-up accountID.	Este bloco contém informações do participante e conta origem do repasse.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.0		DestinationPartyInformation	DstnPtyInf	[1..1]	+	This block contains information about the take-up participant ID and the take-up account ID.	Este bloco contém informações do participante e conta destino do repasse.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[1..1]	+	Details of the Give Up.	Este bloco contém informações relacionadas ao repasse.	
3.1		Quantity	Qty	[1..1]	+	Give-up quantity.	Quantidade repassada.	
3.1.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
5.0		SecurityIdentification	SctyId	[0..1]	+	This block contains the ISIN and ticker symbol Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN e código de negociação.	

5.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
5.2		TickerSymbol	TckrSymb	[0..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
6.0		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttr bts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
6.1		DistributionIdentificat ion	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	

6.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

6.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
6.4		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	

6.5		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente).	
6.5.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
6.6		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Strike of the option.	Preço de exercício da opção.	
6.6.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the strike	Possui o valor financeiro.	
6.6.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.0		TradeDetails	TradDtls	[1..1]	+	Details of the trade.	Este bloco contém detalhes do negócio.	
7.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
7.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
7.3		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	Identification of a specific execution time bracket code through its trading session name or description. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market (Período de negociação que funciona fora do horário regular do pregão). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R2
7.4		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	Indicates trade session origin. E.g, DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Indica a sessão de origem de negociação. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	

7.5		OrderIdentification	OrdrId	[0..1]	Max26Text	Unique identifier for Order assigned by the trading system. This attribute will be filled in if the requester is Trading Participant or Direct Participant.	Número da ordem no sistema eletrônico. Este atributo será preenchido somente se requisitante for Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.	
7.6		TraderIdentification	TradrId	[0..1]	Max50Text	Indicates the trader code.	Este campo informa o código do operador.	
7.7		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTrade SubTypeCode	Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
7.8		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	Indicates number of days settlement in a forward´s contract (equities).	Prazo em dias para a liquidação do contrato a termo de ações.	
7.9		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPayme ntTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Ex: Netting, Gross, Without Financial Transfer e Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	

7.10		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Specifies the type of trade. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeTransactionTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls E.g 0 -Regular trade 29+Exercise complement 38-Block Trade 45-Options exercise	Este bloco identifica o código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 -Regular trade 29+Exercise complement 38-Block Trade 45-Options exercise	
7.11		TransactionDateTime	TxDtTm	[1..1]	ISODateTime	Provides the date and time execution/order creation.	Fornece a Date e hora da execução do negócio.	
7.12		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco informa a quantidade em dinheiro (preço) negociada do instrumentos (comprado ou vendido).	
7.12.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the strike	Possui o valor financeiro.	
7.12.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.13		StrategyTrade	StrtgyTrad	[0..1]	+	It contains information of the strategy.	Contém dados de estratégia.	
7.13.1		ShortFuturePrice	ShrtFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Short leg price.	Valor futuro curto.	
7.13.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmo	Long leg price.	Valor futuro longo.	

					unt			
7.13.3		Delta	Dlta	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delta value.	Valor do Delta.	
7.14		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Specifies the date/time on which the trade was executed.	Este bloco identifica a data e hora em que os instrumentos foram negociados.	
7.14.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
8.0		GiveUpDateAndTime	GvUpDtAndTm	[1..1]	+	Give up Date and Time.	Fornece a data e hora do repasse.	
8.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
9.0		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contains information BACEN auction trades (dollar swap).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial do BACEN.	
9.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctnId	[0..1]	Max8Text	BACEN´s communication number.	Número do comunicado BACEN.	
9.2		AuctionProposalIdentification	AuctnPrpslId	[0..1]	Max6Text	Number of BACEN´s Auction Proposal.	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	
9.3		SelicAccountIdentification	SelicAcctId	[0..1]	Max9NumericText	Selic Account ID.	Identifica a Conta Selic.	
9.4		StartPositionDate	StartPosDt	[0..1]	+	Start position date of the dollar swap trade.	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	
9.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
10.0		Allocation	Allcn	[1..1]	+	This block identifies the allocation identification.	Este bloco identifica o número de alocação.	
10.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
11.0		AllocationStatusAdvice	AllcnStsAdvc	[1..1]	+	This block details the pending status.	Informações de situação de pendência de repasse.	
11.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	

11.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a status for the pending (pending give-up approval or pending take-up cancellation approval). This field requires an external code list. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Possible values: 3- Pending Give Up Approval 8-Pending Take Up Cancellation Approval	Campo que identifica se trata-se de um repasse ou cancelamento de repasse pendente de confirmação. Este campo requer uma lista de código externo. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. Valores possíveis: 3- Pending Give Up Approval (repasse pendente de confirmação) 8-Pending Take Up Cancellation Approval (cancelamento de repasse pendente de confirmação).	
12.0		OffHoursInformation	OffHrsInf	[0..1]	+	This block identifies if the give-up or the take-up cancellation was requested outside the time limit (off-hour) and informs the delay responsible.	Este bloco indica se a solicitação de repasse ou o cancelamento de repasse foi solicitado fora do horário limite (quebra de regra) e informa quem é o faltante.	
12.1		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if it is an off-hour allocation request.	Indica se é uma alocação solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	
12.2		OffHoursDelayResponsibility	OffHrsDelyRspnsblty	[1..1]	ExternalOffHoursDelayResponsibilityCode	It has to be filled up in case of an off-hour allocation. Informs the participant responsible for the off-hour allocation/ "break rule". This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Para o caso de indicação de repasse, informa o participante responsável pelo repasse realizado fora do prazo limite (quebra de regra), Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
13.0		TradeParticipantIdentification	TradPtcptId	[0..1]	+	Trade Participant Code	Código do Participante de Negociação.	
13.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
13.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Trade Participant Code Identification.	Identificação do Código do Participante de Negociação.	

14.0		ETFTradeInformation	ETFTradInf	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados de negociação do trade de ETF.	R3
14.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
14.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
14.3		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperationTypeCode	Informs if the operation is currently a creation or a redemption. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	
14.4		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
14.5		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	

14.6		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrency AndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
14.7		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrency AndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	

bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem TradeManagementReportRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA e permite requisitar consulta de operações, conforme tipos abaixo:

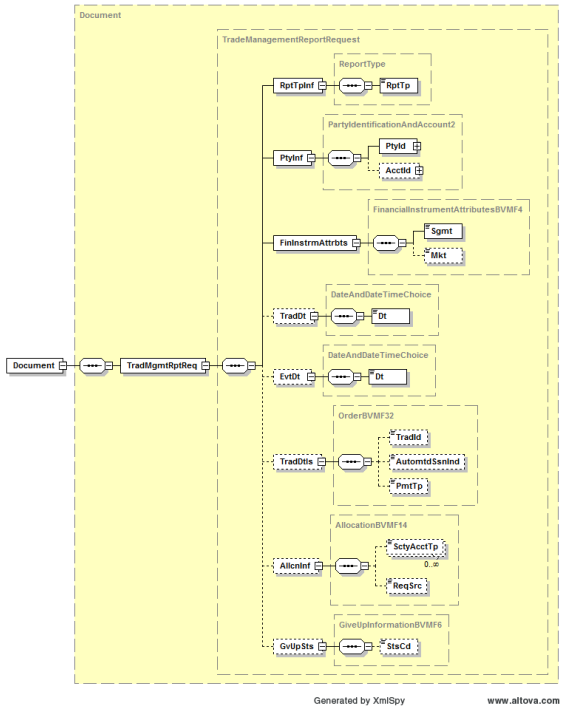
- Negócios Realizados (TradeLegNotification)
- Negócios Alocados* (SecuritiesAllocationDetails)
- Repasses Enviados – Origem (GiveUpTradeDetails)
- Repasses Recebidos– Destino (TakeUpTradeDetails)

* Disponível também para Agentes de Custódia. Apresenta apenas os negócios direcionados ao custodiante.

Uso

Esta mensagem é enviada pelo Participante à BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar uma consulta de operações.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1. Caso o campo data do evento não seja preenchido, serão retornados apenas eventos ocorridos na data corrente.

R2. O campo data do evento (Event Date) apresenta as seguintes características, dependendo do arquivo a ser solicitado:

Se arquivo = TradeLegNotification, Data Evento = Data da negociação e Período disponível para consulta = D-1 a D

Se arquivo = SecuritiesAllocationDetails, Data Evento = Data da alocação e Período disponível para consulta = D-1 a D

Se arquivo = GiveUpTradeDetails, Data Evento = Data do evento de repasse - origem e

Período disponível para consulta = Mercados Derivativos e Derivativos sobre Ações: D
Mercado a vista de ações: D-1 a D

Se arquivo = TakeUpTradeDetails, Data Evento = Data do evento de repasse - destino e
Período disponível para consulta = Mercados Derivativos e Derivativos sobre Ações: D
Mercado a vista de ações: D-1 a D

Onde: D= Data do pregão corrente

R3. Poderá ser selecionado apenas um único tipo de arquivo por mensagem de requisição.

R4. Filtro disponível somente se o Tipo de Relatório informado for " 4 - Allocation Details".

R5. Filtro disponível somente para os Tipos de Relatórios:
" 1 - GiveUpTradeDetails" ou " 2 - TakeUpTradeDetails".

R6. Permitido somente para os Tipos de Relatórios:
" 1 – GiveUp Trade Details" , " 2 – TakeUp Trade Details" ou "4 – Allocation Details".

R7: Opções disponíveis de Relatórios**:**
1 - GiveUp Trade Details
2 - TakeUp Trade Details
3 - Captured Trade Details
4 - Allocation Details

bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportTypeInformation	RptTpInf	[1..1]	+	Type of requested report.	Tipo do relatório solicitado.	R3,R7

1.1		ReportType	RptTp	[1..1]	ExternalReport TypeCode	Type of requested report. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalReportTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de relatório solicitado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalReportTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains information about the party identification and account identification as request parameter.	Este bloco contém informações sobre a identificação do participante e da conta como parâmentro da solicitação.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este	

						should be filled with default value = 39.	campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	This block contains request´s parameters of elements characterising a financial instrument.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
3.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

3.2		Market	Mkt	[0..1]	ExternalMarketCode	Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.0		TradeDate	TradDt	[0..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	R6
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	

5.0		EventDate	EvtDt	[0..1]	+	Indicates the date as follows: - Give up request: give up event date - Take up request : take up event date - Allocation details: allocation event date - Captured trades request: capture trade date. If left empty, report will return current day events.	Informa a data, de acordo com o cenário abaixo: - Give up Trade Details : refere-se à data do evento de envio do repasse (Origem); - Take up Trade Details : refere-se à data do evento de recebimento de repasse (Destino); - Allocation Details: refere-se à data do evento da alocação; - Captured Trade Details :refere-se à data da captura do negócio. Se este campo for deixado em branco, retornará os eventos referentes à data corrente.	R1,R2
5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
6.0		TradeDetails	TradDtls	[0..1]	+	This block contains information related to trade.	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio.	
6.1		TradeIdentification	TradId	[0..1]	Max35Text	Reference assigned to the trade.	Número do negócio.	
6.2		AutomatedSessionIndicator	AutomtdSsnInd	[0..1]	YesNoIndicator	Indicates if the trade is from Automated Session or Non Automated Session.	Indica se o trade é originado de uma sessão automática ou de uma sessão não automatizada.	

6.3		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	This field identifies the settlement type . This filed requires an external codlelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	
7.0		AllocationInformation	AllcnInf	[0..1]	+	This block contains information about allocation.	Este bloco contém informações sobre alocação.	
7.1		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[0..*]	ExternalSecurityAccountTypeCode	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R4
7.2		RequestSource	ReqSrc	[0..1]	ExternalRequestSourceCode	Indicates the allocation source. Only applicable for intraday requests. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalRequestSourceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Código identificador da origem da solicitação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é	

							ExternalRequestSourceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
8.0		GiveUpStatus	GvUpSts	[0..1]	+	This block contains information on the situation of GiveUp.	Este bloco contém informações sobre a situação do repasse.	R5
8.1		StatusCode	StsCd	[0..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Informa o Status do Give Up. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

bvmf.170.01 – ETFTradeNotification

Funcionalidade

Escopo

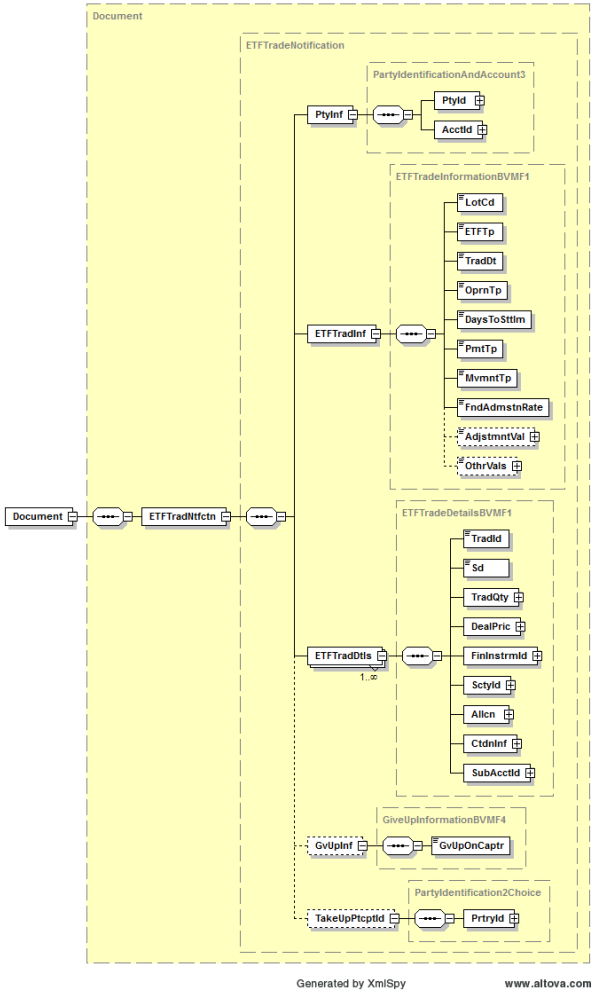
A mensagem de criação de ETF “ETFTradeNotification” (bvmf.170.01) é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, com o objetivo de informar a realização de operação de Integralização/Resgate de cotas realizada no sistema primário de negociação.

Uso

Esta mensagem disponibiliza detalhes dos negócios realizados pelo Participante de Negociação Pleno durante a data de movimento vigente.

Além do número de negócio e demais detalhes referentes ao instrumento negociado, a BM&FBOVESPA informará o número da alocação para cada negócio realizado. Este número será chave e deverá ser informado no processo de direcionamento de Custodiante caso este seja realizado posteriormente

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

bvmf.170.01 – ETFTradeNotification

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains the participant and account identification.	Este bloco contém a identificação do participante e conta.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.0		ETFTradeInformation	ETFTradInf	[1..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados da negociação do trade do ETF.	
2.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	

2.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the date of trade transaction.	Fornece a data do pregão.	
2.4		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperationTypeCode	Informs if the operation is currently a creation or a redemption. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	
2.5		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[1..1]	Max4Text	Indicates number of days to settlement.	Prazo em dias para liquidação.	

2.6		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	Especifica como a transação deve ser resolvida, EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls	
2.7		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
2.8		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	

2.9		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
2.10		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
3.0		ETFTradeDetails	ETFTradDtls	[1..*]	+	Provides the details of trades associated with the ETF business.	Fornece os detalhes de trades associados ao negócio ETF.	
3.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Numero do negócio.	
3.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
3.3		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+	Shows the quantity of financial ETF instruments.	Apresenta a quantidade de instrumentos financeiros ETF.	

3.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Specifies the price of the traded financial instrument.	Especifica o preço do instrumento financeiro negociado.	
3.4.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
3.4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
3.5		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece os detalhes de identificação do instrumento.	
3.5.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.5.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	

3.5.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
3.5.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.5.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.6		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the Security Identification.	Este bloco contém as informações de código da negociação.	
3.6.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
3.7		Allocation	Allcn	[1..1]	+	This block identifies the allocation identification.	Este bloco identifica o código de alocação.	
3.7.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	

3.8		CustodianInformation	CtdnInf	[1..1]	+	Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e conta de custódia.	
3.8.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.8.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.8.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.8.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

3.8.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.8.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
3.8.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.8.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.9		SubAccountIdentification	SubAcctId	[1..1]	+	Provides identification of the sub account. Provides identification of the sub account.	Fornece a identificação da carteira na depositária	
3.9.1		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
4.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..1]	+	This block informs if the captured account has a give-up link.	Este bloco informa se a conta capturada possui vínculo de repasse.	
4.1		GiveUpOnCapture	GvUpOnCaptr	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	

5.0		TakeUpParticipantIdentification	TakeUpPtcptId	[0..1]	+	This block identifies the Take Up participant in case give up.	Este bloco identifica o participante destino no caso de repasse.	
5.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

BVBG.012.01 – TradeLegNotification

Funcionalidade

Escopo

O arquivo de Negócios Realizados ou “TradeLegNotification” (BVBG.012.01) é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno e detalha os negócios realizados pelo Participante.

Uso

O arquivo de Negócios Realizados (BVBG.012.01) contém todos os negócios realizados no dia até o momento de sua geração. Pode ser solicitado sob demanda, como resposta da mensagem de solicitação “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02), e seleção do tipo de arquivo “TradeLegNotification”, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Diagrama da Mensagem

O arquivo de Negócios Realizados ou “TradeLegNotification” (BVBG.012.01) é composto pelas mensagens “TradeLegNotification” (bvmf.012.01) e ETFTradeNotification (bvmf.170.01).

O diagrama das mensagens bvmf.012.01 e bvmf.170.01 estão representados neste documento, na seção a que se refere às mensagens.

Regras

R1. Caso o campo data do evento (refere-se à data de negociação) não seja preenchido, serão retornados apenas negócios realizados na data corrente.

R2. Negócios originados pela quebra de estratégias não são contemplados neste arquivo.

R3. O arquivo TradeLegNotification é enviado automaticamente ao final do dia, e contemplará todas as operações realizadas na data corrente.

Estrutura da mensagem "TradeLegNotification" (bvmf.012.01)

O header do arquivo está no Manual Técnico

A estrutura da mensagem bvmf.012.01 pode ser consultada neste documento, através da mensagem bvmf.012.01.

Estrutura da mensagem "ETFTradeNotification" (bvmf.170.01)

O header do arquivo está no Manual Técnico

A estrutura da mensagem bvmf.170.01 pode ser consultada neste documento, através da mensagem bvmf.170.01.

BVBG.013.02 – SecuritiesAllocationDetails

Funcionalidade

Escopo

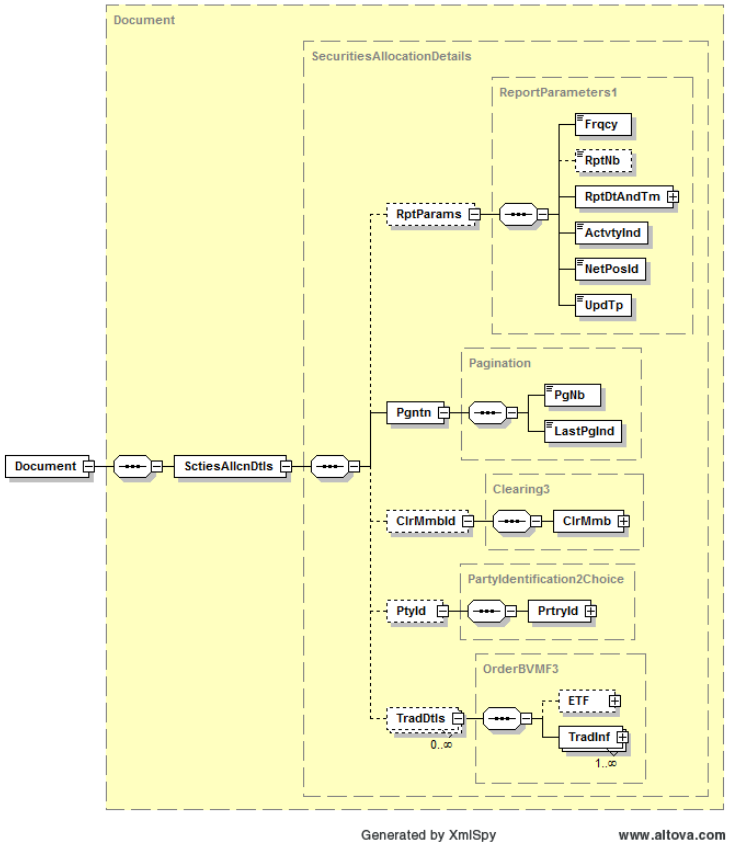
O arquivo de Negócios Alocados “SecuritiesAllocationDetails” (BVBG.013.02) é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Agente de Custódia e apresenta todos os negócios alocados pertencentes ao Participante. Os Agentes de Custódia tem acesso apenas a operações direcionadas ao seu próprio Agente.

Uso

O arquivo pode ser solicitado sob demanda, como resposta da mensagem de solicitação “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02), e seleção do tipo de arquivo “SecuritiesAllocationDetails”, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Diagrama da Mensagem

O arquivo de Negócios Alocados “SecuritiesAllocationDetails” (BVBG.013.02) é composto pela mensagem “SecuritiesAllocationDetails” (bvmf.020.02).



Regras

R1. Caso o campo data do evento (refere-se à data do pregão se o arquivo selecionado for SecuritiesAllocationDetails) não seja preenchido, serão retornados apenas eventos ocorridos na data vigente.

R2. Negócios originados pela quebra de estratégias não são contemplados neste arquivo.

R3. O arquivo SecuritiesAllocationDetails é enviado automaticamente ao final do dia, e contemplará operações da data da negociação até a data final (limite) de alocação vigente, respeitando-se os diferentes prazos limites por tipo de mercado.
R4. Os negócios oriundos de sessão after-market, cuja data de pregão é posterior à data de negociação corrente (aplicável às operações do segmento de derivativos, negociados em sessões não regulares), serão apresentados nos arquivos gerados automaticamente ao final do dia de ambas as datas (data de negociação e data do pregão da operação after market).
R5. Este campo somente será preenchido para equities.

Estrutura da mensagem "SecuritiesAllocationDetails" (bvmf.020.02)

O header do arquivo está no Manual Técnico

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[0..1]	+	Parameters related to the allocation details response.	Parâmetros relacionados à mensagem de resposta de detalhes de alocação.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	

1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	O número de página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuidade para indicar que o documento é para continuar ou que a mensagem é a última página do documento.	
2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
3.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[0..1]	+	Provides details about the clearing details identification.	Fornece detalhes do Membro de Compensação.	
3.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
3.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 2-123456, where 2 means CM (Clearing Member).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 2-123456, onde 2 significa MC (Membro de Compensação).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		PartyIdentification	PtyId	[0..1]	+	Identifies the requester party details.	Este bloco identifica o participante que está requisitando a informação.	
4.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.0		TradeDetails	TradDtls	[0..*]	+	Details of the trade.	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio.	
5.1		ETF	ETF	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados da negociação do trade do ETF.	
5.1.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
5.1.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

5.1.3		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperation TypeCode	Informs if the operation is currently a creation or a redemption. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	
5.1.4		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	Indicates number of days to settlement.	Prazo em dias para liquidação.	
5.1.5		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
5.1.6		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovement TypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
5.1.7		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	
5.1.8		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
5.2		TradeInformation	TradInf	[1..*]	+	Provides Trade information.	Este bloco contém detalhes do negócios.	
5.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

5.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
5.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
5.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
5.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
5.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
5.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

5.2.2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

5.2.2.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

5.2.2.3		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
5.2.2.4		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o estilo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	
5.2.2.4.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
5.2.2.5		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	

5.2.2.6		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
5.2.2.7		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
5.2.2.8		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	

5.2.2.9		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	This field identifies the settlement type . Example: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This filed requires an externalcodlelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date and time.	Fornece a data e hora do pregão.	
5.2.3.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
5.2.4		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Specifies the type of transaction of which the order is a component. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeTransactionTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Codigo do Tipo de Negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

5.2.5		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	Further qualification to the trade type This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.6		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Reference assigned to the trade.	Número do negócio.	
5.2.7		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco informa a quantidade em dinheiro (preço) negociada dos instrumentos (comprados ou vendidos).	
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
5.2.8		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUY e SELL	
5.2.9		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	Identification of a specific execution time bracket code through its trading session name or description. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market (Período de negociação que funciona fora do horário regular do pregão). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R5

5.2.10		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max35Text	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
5.2.11		OrderIdentification	OrdrId	[0..1]	Max26Text	Unique identifier for Order assigned by the trading system. This attribute will be filled in if the requester is Trading Participant or Direct Participant.	Número da ordem no sistema eletrônico. Este atributo será preenchido somente se requisitante for Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.	
5.2.12		TradeMatchIdentification	TradMtchId	[0..1]	Max10Text	Identifier assigned to a trade by a matching system. This attribute will be filled in if the requester is Trading Participant or Direct Participant.	Identificador atribuido por um sistema de Matching. Este atributo será preenchido somente se requisitante for Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.	
5.2.13		TraderIdentification	TradrId	[0..1]	Max50Text	Indicates the trader code. This attribute will be filled in if the requester is Trading Participant or Direct Participant.	Este atributo informa o código do operador. Este atributo será preenchido somente se requisitante for Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.	
5.2.14		Allocation	Allcn	[0..*]	+	It specifies how the trades have to be allocated.	Este bloco contém os dados de alocação que foram feitas para determinado negócio.	
5.2.14.1		PartyInformation	PtyInf	[0..1]	+	This block identifies the Trading Participant or Direct Participant resposible for allocation.	Este bloco identifica o participante de negociação pleno ou participante de liquidação que realizou a alocação do negócio.	
5.2.14.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante de negociação pleno ou participante de liquidação que realizou a alocação do negócio.	
5.2.14.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

5.2.14.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.2.14.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.2.14.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.2.14.1.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification under the Trading Participant or Direct Participant .	Fornece dados de identificação da conta alocada no participante de negociação pleno ou participante de liquidação.	
5.2.14.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.2.14.1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

5.2.14.2		SecurityAccount Type	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.14.3		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Provides custodian details	Este bloco identifica o custodiante relacionado com a alocação.	
5.2.14.3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante de negociação pleno ou participante de liquidação que realizou a alocação do negócio.	
5.2.14.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
5.2.14.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 1-123456, where 1 means CST (Custodian).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 1-123456, onde 1 significa CST (Agente de Custódia).	

5.2.14.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.2.14.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.2.14.3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides custodian account identification.	Fornece dados de identificação da conta no agente de custódia.	
5.2.14.3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.2.14.3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.2.14.4		RequestSourceInformation	ReqSrcInf	[0..1]	+	Indicates the source of the request. This information is available only if the requester is TP or DP.	Informa a origem da alocação. Esta informação é disponível somente se o requisitante é um PNP ou PL.	
5.2.14.4.1		RequestSource	ReqSrc	[1..1]	ExternalRequestSourceCode	Indicates the source code of the request. This field requires an external code list.Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalRequestSourceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Código identificador da origem da solicitação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRequestSourceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.14.5		AllocationStatus	AllcnSts	[0..1]	+	Indicates the allocation status. Only applicable for intraday requests.	Indica o status da alocação. Somente aplicável se requisição for intradia.	

5.2.14.5.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls Possible status: - Successfully processed – Pending risk approval – Pending off hour analysis – Off hour rejected – Allocation exclusion rejected due to risk assessment	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Domínios possíveis: - Successfully processed – Pending risk approval – Pending off hour analysis – Off hour rejected – Allocation exclusion rejected due to risk assessment	
5.2.14.6		Quantity	Qty	[1..1]	+	Specifies the quantity related to the allocation.	Informa a quantidade relativa à alocação.	
5.2.14.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.2.14.7		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	
5.2.14.8		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number. Provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA .	
5.2.14.9		AllocationDateTime	AllcnDtTm	[1..1]	ISODateTime	Informs date and time of allocation.	Informa a data e hora da alocação.	
5.2.14.10		GiveUpPartyIdentification	GvUpPtyId	[0..1]	+	This block identifies the GiveUp Participant – if applicable . This information is available only if the requester is TP or DP.	Este bloco identifica o participante que realizou o repasse (Participante Origem do repasse) – se aplicável repasse. Esta informação é disponível somente se o requisitante for o PNP ou PL.	

5.2.14.10.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
5.2.14.10.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.2.14.10.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.2.14.10.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.2.14.11		GiveUp	GvUp	[0..1]	+	Provide GiveUp details . This information is available only if the requester is TP or DP.	Informa detalhes sobre o GiveUp. Esta informação é disponível somente se o requisitante for o PNP ou PL.	
5.2.14.11.1		GiveUpDateTime	GvUpDtTm	[1..1]	ISODateTime	Indicates the give-up date and time.	Indica a data e hora do repasse.	
5.2.14.12		OffHoursInformation	OffHrsInf	[0..1]	+	Indicates a break rule in case of an allocation sent after the time limit.	Informa detalhes sobre a quebra de regra.	
5.2.14.12.1		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if it is an off-hour allocation request	Indica se é uma alocação sendo solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	

BVBG.014.02 – GiveUpTradeDetails

Funcionalidade

Escopo

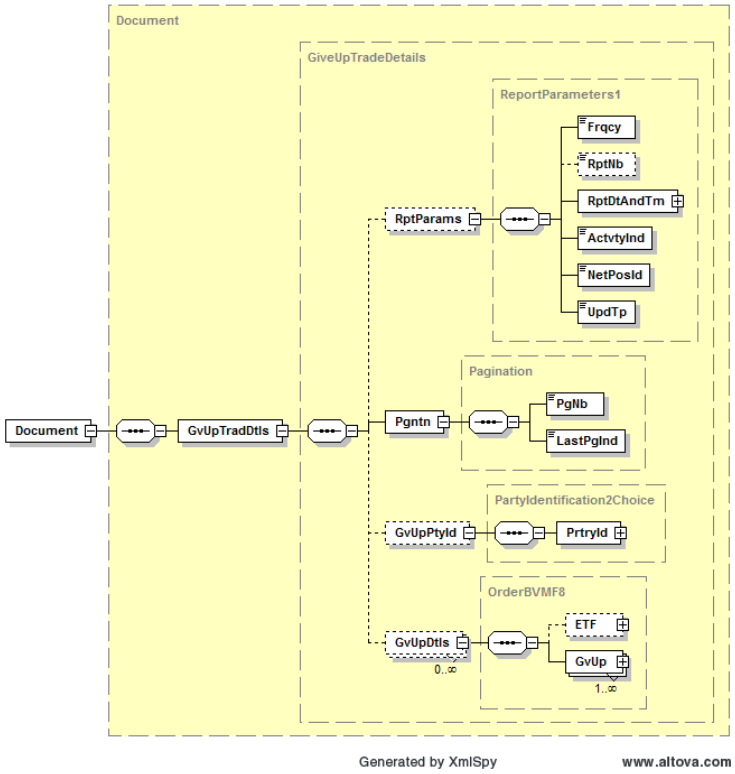
O arquivo de Repasses Enviados ou "GiveUpTradeDetails", é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno (Participante Origem do repasse), e apresenta os últimos eventos de repasse enviados pelo Participante.

Uso

O arquivo pode ser solicitado sob demanda, como resposta da mensagem de solicitação "TradeManagementReportRequest" (bvmf.018.02), e seleção do tipo de arquivo "GiveUpTradeDetails", e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.014.02 é composto pela mensagem bvmf.021.02.



Regras

R1. Caso o campo data do evento (refere-se à data do evento de repasse) não seja preenchido, serão retornados apenas eventos ocorridos na data vigente.
R2. Negócios originados pela quebra de estratégias não são contemplados neste arquivo.
R3. Este campo somente será preenchido para equities.

Estrutura da mensagem "GiveUpTradeDetails" (bvmf.021.02)

O header do arquivo está no Manual Técnico

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[0..1]	+	Parameters related to the give up trade.	Parâmetros relacionados ao relatório de give up trade.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	

1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	O número de página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuidade para indicar que o documento é para continuar ou que a mensagem é a última página do documento.	
2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
3.0		GiveUpPartyIdentification	GvUpPtyId	[0..1]	+	This block identifies the party who performed the give up (origin party) .	Este bloco identifica o participante de negociação pleno que realizou o repasse (give up).	
3.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		GiveUpDetails	GvUpDtls	[0..*]	+	Contais all Give Up transaction details	Contém todos os detalhes das transações de Give Up	
4.1		ETF	ETF	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados da negociação do trade do ETF.	
4.1.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
4.1.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.1.3		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperationTypeCode	Informs if the operation is currently a creation or a redemption. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	

4.1.4		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
4.1.5		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	
4.1.6		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
4.1.7		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
4.2		GiveUp	GvUp	[1..*]	+	GiveUp details.	Este bloco contém informações de repasse do negócio.	
4.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
4.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	

4.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
4.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
4.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Contains all information necessary to list the financial instrument	Elementos que caracterizam um instrumento.	

4.2.2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

4.2.2.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.2.3		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains ISIN and Ticker symbol Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN e do Ticker Symbol.	

4.2.2.3.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
4.2.2.3.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3.	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
4.2.2.4		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
4.2.2.5		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Used to identify the type of Option, when the Financial instrument is a Option	Este bloco identifica se o tipo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	

4.2.2.5.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
4.2.2.6		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um contrato. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
4.2.2.7		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	

4.2.2.8		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	This field identifies the settlement type . This filed requires an external codlelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	
4.2.2.9		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado que determinará a compra ou venda de um papel pelo detentor de um derivativo.	
4.2.2.9.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the price.	Possui um valor financeiro ligado a uma ordem ou instrumento.	
4.2.2.9.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.2.3		TradeAndGiveUpDetails	TradAndGvUpDtls	[0..*]	+	This block contains trade and Give Up details.	Este bloco contém detalhes do negócio e do Give Up.	
4.2.3.1		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	It detail the trades information regarding the financial intrument listed	Este bloco contém detalhes do negócio.	

4.2.3.1.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date and time.	Fornece a data e hora do pregão.	
4.2.3.1.1.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
4.2.3.1.2		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Specifies the type of transaction of which the order is a component. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeTransactionTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Codigo do Tipo de Negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.2.3.1.3		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.3.1.4		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Reference assigned to the trade.	Número do negócio.	
4.2.3.1.5		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco informa a quantidade em dinheiro (preço) negociada dos instrumentos (comprados ou vendidos)	
4.2.3.1.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	

4.2.3.1.6		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
4.2.3.1.7		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	Identification of a specific execution time bracket code through its trading session name or description. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market (Período de negociação que funciona fora do horário regular do pregão). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R3
4.2.3.1.8		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	Indicates number of days settlement in a forward´s contract	Prazo em dias para a liquidação do contrato.	
4.2.3.1.9		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
4.2.3.1.10		OrderIdentification	OrdrId	[0..1]	Max26Text	Unique identifier for Order assigned by the trading system.	Número da ordem no sistema eletrônico	
4.2.3.1.11		TradeMatchIdentification	TradMtchId	[0..1]	Max10Text	Trade identification assigned by the trading system.	Número de negócio no sistema eletrônico.	
4.2.3.1.12		TraderIdentification	TradrId	[0..1]	Max50Text	Indicates the trader code.	Este campo informa o código do operador.	
4.2.3.1.13		StrategyTrade	StrtgyTrad	[0..1]	+	It contains datas of delta Strategy.	Contém dados de estratégia Delta.	
4.2.3.1.13.1		ShortFuturePrice	ShrtFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Short leg price.	Valor futuro curto.	
4.2.3.1.13.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHisto	Long leg price.	Valor futuro longo.	

					ricCurrencyAnd3DecimalAmount			
4.2.3.1.13.3		Delta	Dlta	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delta value.	Valor do Delta.	
4.2.3.1.14		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
4.2.3.1.14.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctnId	[0..1]	Max8Text	BACEN´s communication number.	Número do comunicado BACEN.	
4.2.3.1.14.2		AuctionProposalIdentification	AuctnPrpslId	[0..1]	Max6Text	Number of BACEN´s Auction Proposal.	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	
4.2.3.1.14.3		SelicAccountIdentification	SelicAcctId	[0..1]	Max9NumericText	Selic Account ID.	Identifica a Conta Selic.	
4.2.3.1.14.4		StartPositionDate	StartPosDt	[0..1]	+	Start position date of the dollar swap trade.	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	
4.2.3.1.14.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.2.3.2		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..*]	+	This component contains details for each party involved in a GiveUp transaction	Este bloco contém os detalhes de um repasse feito pelo participante.	
4.2.3.2.1		GiveUpAccountIdentification	GvUpAcctId	[1..1]	+	Provides Give Up account identification.	Fornece dados de identificação da conta que originou o repasse.	
4.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.3.2.2		TakeUpParticipantInformation	TakeUpPtcptInf	[1..1]	+	This block identifies the take-up participant and respective account ID.	Este bloco identifica o participante destino e sua respectiva conta do repasse.	

4.2.3.2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante de negociação pleno ou participante de liquidação que realizou a alocação do negócio.	
4.2.3.2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.2.3.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.2.3.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2.3.2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides Take Up account identification.	Fornece dados de identificação da conta destino do repasse.	
4.2.3.2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

4.2.3.2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.3.2.3		GiveUpOnCapture	GvUpOnCaptr	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if the give up was originated due to a trade capture.	Indica se o repasse foi originado através de captura de conta com vínculo de repasse.	
4.2.3.2.4		Quantity	Qty	[1..1]	+	Informs the give-up quantity.	Quantidade repassada.	
4.2.3.2.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
4.2.3.2.5		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número da alocação na BM&FBOVESPA.	
4.2.3.2.5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
4.2.3.2.6		GiveUpDateTime	GvUpDtTm	[1..1]	+	Indicates the give-up date and time.	Indica a data e hora do repasse.	
4.2.3.2.6.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
4.2.3.2.7		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	Informs the give up status: -pending give up approval, -give up approved or -give up rejected -pending take-up cancellation approval; -take-up cancellation approved by give-up participant; -take-up cancellation rejected by give-up participant.	Informa o status do GiveUp: -Pendente de aprovação; -Aprovado; -Rejeitado; -Pendente de aprovação de cancelamento de repasse; -Cancelamento de repasse aprovado pelo participante origem; -Cancelamento de repasse rejeitado pelo participante origem.	

4.2.3.2.7.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.3.2.8		OffHoursInformation	OffHrsInf	[1..1]	+	Indicates a break rule in case of an allocation sent after the time limit	Este bloco indica se houve quebra de regra no caso de uma alocação enviada após o horário limite.	
4.2.3.2.8.1		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if it is an off-hour allocation request	Indica se é uma alocação sendo solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	

BVBG.015.02 – TakeUpTradeDetails

Funcionalidade

Escopo

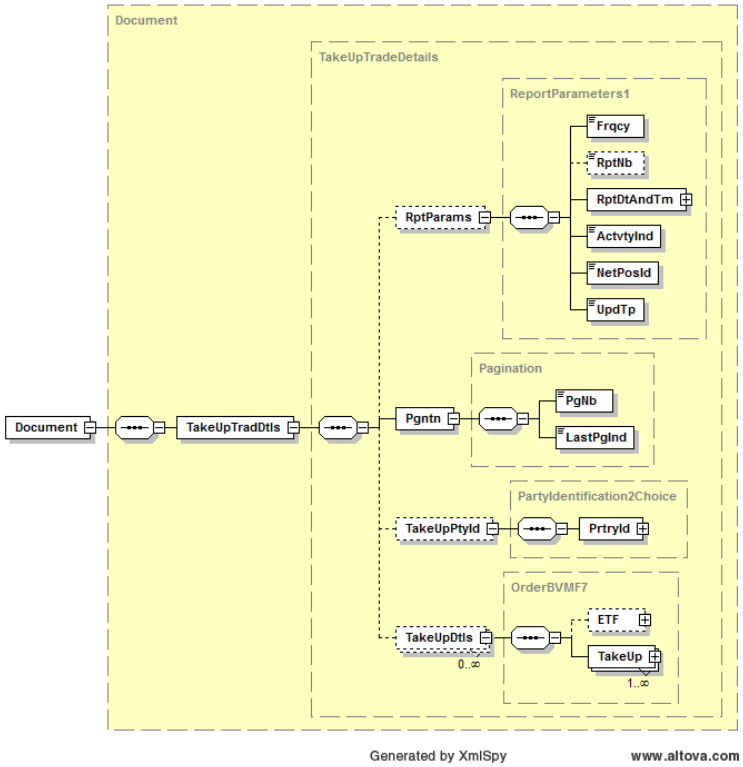
O arquivo de Repasses Recebidos ou “TakeUpTradeDetails” é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação (Participante Destino do repasse), e apresenta os últimos eventos de repasse recebidos pelo Participante.

Uso

O arquivo pode ser solicitado sob demanda, como resposta da mensagem de solicitação “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02), e seleção do tipo de arquivo “TakeUpTradeDetails”, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “TakeUpTradeDetails” (BVBG.015.02) é composto pela mensagem ““TakeUpTradeDetails” (bvmf.022.02).



Regras

R1. Caso o campo data do evento (refere-se à data do evento de repasse) não seja preenchido, serão retornados apenas eventos ocorridos na data vigente.
R2. Negócios originados pela quebra de estratégias não são contemplados neste arquivo.
R3. Este campo somente será preenchido para equities.

Estrutura da mensagem "TakeUpTradeDetails "(bvmf.022.02)

O header do arquivo está no Manual Técnico.

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[0..1]	+	Parameters related to the take up trade.	Parâmetros relacionados ao relatório de take up trade.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	

1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	O número de página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuidade para indicar que o documento é para continuar ou que a mensagem é a última página do documento.	
2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
3.0		TakeUpPartyIdentification	TakeUpPtyId	[0..1]	+	This block identifies the take-up party.	Este bloco identifica o participante destino do repasse (take up).	
3.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		TakeUpDetails	TakeUpDtls	[0..*]	+	Contais all TakeUp transaction details	Contém todos os detalhes das transações de Take Up	
4.1		ETF	ETF	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados da negociação do trade do ETF.	
4.1.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
4.1.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

4.1.3		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperationTypeCode	Informs if the operation is currently a creation or a redemption. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	
4.1.4		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
4.1.5		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	
4.1.6		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
4.1.7		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
4.2		TakeUp	TakeUp	[1..*]	+	TakeUp details.	Contém informações das transações de Take Up	
4.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
4.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
4.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores	

						Values: 8. (Security source).	válidos 8. (Security source).	
4.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
4.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Contains all information necessary to list the financial instrument	Elementos que caracterizam um instrumento.	
4.2.2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de	

							acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

4.2.2.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.2.3		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains ISIN and Ticker symbol Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN e do Ticker Symbol.	

4.2.2.3.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
4.2.2.3.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3.	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
4.2.2.4		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
4.2.2.5		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Used to identify the type of Option, when the Financial instrument is a Option	Este bloco identifica se o tipo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	
4.2.2.5.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	

4.2.2.6		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um contrato. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
4.2.2.7		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
4.2.2.8		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado que determinará a compra ou venda de um papel pelo detentor de um derivativo.	
4.2.2.8.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the strike	Possui o valor financeiro.	
4.2.2.8.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	

4.2.2.9		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	This field identifies the settlement type . This filed requires an external codlelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	
4.2.3		TradeAndTakeUpDetails	TradAndTakeUpDtls	[0..*]	+	This block contains trade and Take Up details.	Este bloco contém detalhes do negócio e do Take Up.	
4.2.3.1		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	It detail the trades information regarding the financial intrument listed	Detalha informações do negócio	
4.2.3.1.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date and time.	Fornece a data e hora do pregão.	
4.2.3.1.1.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
4.2.3.1.2		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Specifies the type of transaction of which the order is a component. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeTransactionTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Codigo do Tipo de Negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

4.2.3.1.3		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.3.1.4		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Reference assigned to the trade.	Número do negócio.	
4.2.3.1.5		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco informa a quantidade em dinheiro (preço) negociada dos instrumentos (comprados ou vendidos)	
4.2.3.1.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.2.3.1.6		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
4.2.3.1.7		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	Identification of a specific execution time bracket code through its trading session name or description. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market (Período de negociação que funciona fora do horário regular do pregão). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R3
4.2.3.1.8		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	Indicates number of days settlement in a forward´s contract	Prazo em dias para a liquidação do contrato.	
4.2.3.1.9		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
4.2.3.1.10		OrderIdentification	OrdrId	[0..1]	Max26Text	Unique identifier for Order assigned by the trading system.	Número da ordem no sistema eletrônico	

4.2.3.1.11		TradeMatchIdentification	TradMtchId	[0..1]	Max10Text	Trade identification assigned by the trading system.	Número de negócio no sistema eletrônico.	
4.2.3.1.12		TraderIdentification	TradrId	[0..1]	Max50Text	Indicates the trader code.	Este campo informa o código do operador.	
4.2.3.1.13		StrategyTrade	StrtgyTrad	[0..1]	+	It contains datas of delta Strategy.	Contém dados de estratégia Delta.	
4.2.3.1.13.1		ShortFuturePrice	ShrtFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Short leg price.	Valor futuro curto.	
4.2.3.1.13.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Long leg price.	Valor futuro longo.	
4.2.3.1.13.3		Delta	Dlta	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delta value.	Valor do Delta.	
4.2.3.1.14		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
4.2.3.1.14.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctnId	[0..1]	Max8Text	BACEN´s communication number.	Número do comunicado BACEN.	
4.2.3.1.14.2		AuctionProposalIdentification	AuctnPrpslId	[0..1]	Max6Text	Number of BACEN´s Auction Proposal.	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	
4.2.3.1.14.3		SelicAccountIdentification	SelicAcctId	[0..1]	Max9NumericText	Selic Account ID.	Identifica a Conta Selic.	
4.2.3.1.14.4		StartPositionDate	StartPosDt	[0..1]	+	Start position date of the dollar swap trade.	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	
4.2.3.1.14.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.2.3.2		TakeUpInformation	TakeUpInf	[0..*]	+	This component contains details for each party involved in a GiveUp transaction	Detalhes do repasse realizado.	
4.2.3.2.1		TakeUpAccountIdentification	TakeUpAcctId	[1..1]	+	Provides Take Up account identification.	Fornece dados de identificação da conta destino do repasse.	

4.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.3.2.2		GiveUpParticipantInformation	GvUpPtcptInf	[1..1]	+	This block identifies the gibve-up participant (origin) and its account identification.	Este bloco identifica o participante origem do repasse e a respectiva conta origem do repasse.	
4.2.3.2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante de negociação pleno ou participante de liquidação que realizou a alocação do negócio.	
4.2.3.2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.2.3.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.2.3.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

4.2.3.2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides give-up account identification.	Fornece dados de identificação da conta origem do repasse.	
4.2.3.2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.3.2.3		Quantity	Qty	[1..1]	+	Informs quantity which has been taken-up	Quantidade repassada.	
4.2.3.2.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
4.2.3.2.4		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número da alocação na BM&FBOVESPA	
4.2.3.2.4.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
4.2.3.2.5		GiveUpDateTime	GvUpDtTm	[1..1]	+	Indicates the give-up date and time.	Indica a data e hora do repasse.	
4.2.3.2.5.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
4.2.3.2.6		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	Informs the Take Up status: - Pending approval, - Give-up approved - Give-up rejected. - Pending take-up cancellation approval - Take-up cancellation approved by give-up participant - Take-up cancellation rejected by give-up participant.	Informa o Status do repasse: - Pendente de aprovação; - Repasse Aprovado; - Repasse Rejeitado; - Pendente de aprovação de cancelamento de repasse. - Cancelamento de repasse aprovado pelo participante origem - Cancelamento de repasse rejeitado pelo participante origem.	

4.2.3.2.6.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
4.2.3.2.7		OffHoursInformation	OffHrsInf	[1..1]	+	Indicates a break rule in case of an allocation sent after the time limit.	Este bloco indica se houve quebra de regra no caso de uma alocação enviada após o horário limite.	
4.2.3.2.7.1		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates if it is an off-hour allocation request	Indica se é uma alocação sendo solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	
4.2.3.2.8		TradeParticipantIdentification	TradPtcptId	[0..1]	+	Trade Participant Code	Código do Participante de Negociação.	
4.2.3.2.8.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.3.2.8.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Trade Participant Code Identification	Identificação do Código do Participante de Negociação.	

BVBG.037.01 – SecuritiesAllocationInstruction

Funcionalidade

Escopo

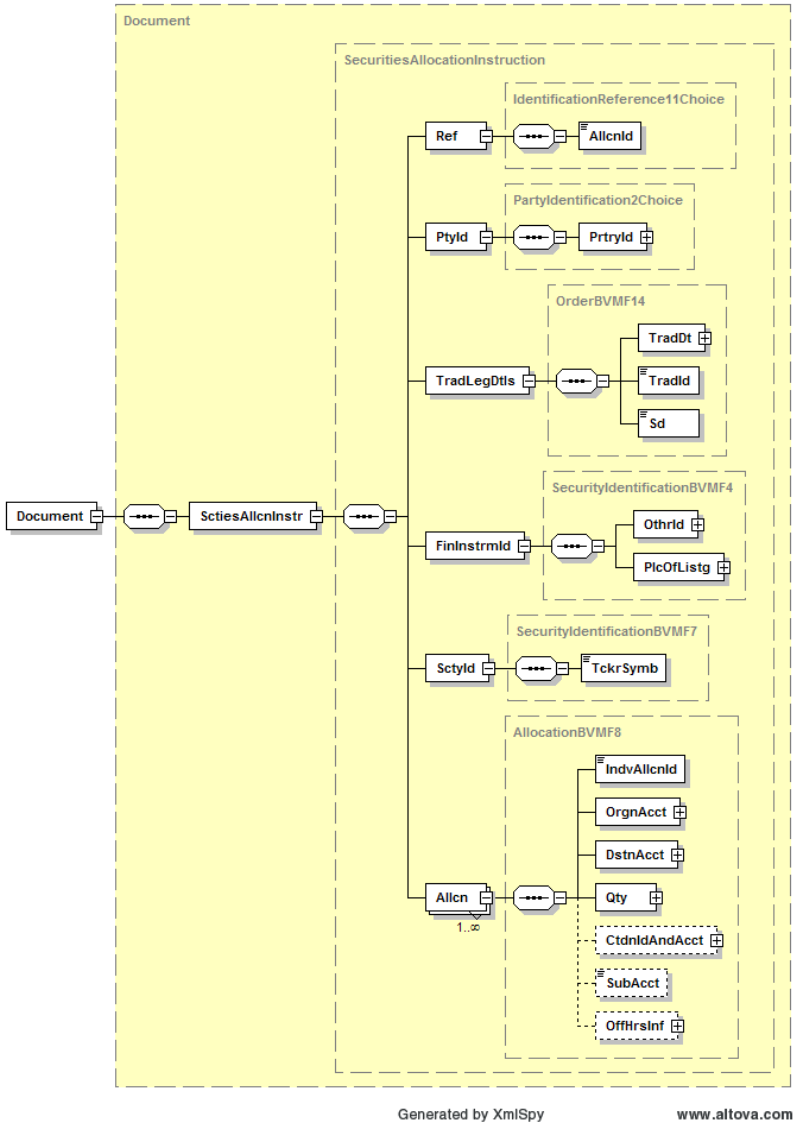
O arquivo “SecuritiesAllocationInstruction” é enviado pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA, para solicitar a inclusão de alocação ou repasse de negócios.

Uso

O arquivo é utilizado somente para contingência no caso de indisponibilidade da mensageria.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “SecuritiesAllocationInstruction” (BVBG.037.01) é composto por mensagens “SecuritiesAllocationInstruction” (bvmf.013.01).


Document
SecuritiesAllocationInstruction
IdentificationReference11Choice
Ref
AllcnId
PartyIdentification2Choice
PtyId
PrtryId
OrderBVMF14
TradDt
TradLegDtls
TradId
Sd
SecurityIdentificationBVMF4
Document
SctiesAllcnInstr
FinInstrmId
OthrId
PlcOfListg
SecurityIdentificationBVMF7
SctyId
TckrSymb
AllocationBVMF8
IndvAllcnId
OrgnAcct
DstnAcct
Allcn
Qty
1..∞
CtdnIdAndAcct
SubAcct
OffHrsInf
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1. Para cada arquivo BVBG.037.01 enviado, a BM&FBOVESPA enviará um arquivo de resposta (BVBG.038.02), apresentando a primeira situação das solicitações enviadas. Exemplo:

- Supondo o envio do arquivo BVBG.037.01, contendo diversas solicitações de alocação e repasse
- O arquivo BVBG.038.02 retornará a primeira situação de cada solicitação enviada no arquivo BVBG.037.01. Por exemplo, no caso de inclusão de conta com vínculo de repasse, a situação desta solicitação informada ao Participante será "pendente de aprovação de repasse". Não será enviado novo arquivo BVBG.038.02 quando houver alteração na situação da operação (aprovação ou rejeição do repasse).
- No caso de necessidade de acompanhamento de situações não contempladas no arquivo BVBG.038.02, o participante poderá realizar consulta nas telas do sistema ou por meio de solicitação de arquivos de consulta (BVBG.040.02).

R2. O Participante deverá informar à BM&FBOVESPA a necessidade de uso do canal de contingência. Ou seja, não poderá ser enviado pelo participante, concomitantemente, arquivos de contingência e mensagens.

Estrutura da mensagem" SecuritiesAllocationInstruction" (bvmf.013.01)

O header do arquivo está no Manual Técnico.

bvmf.013.01 – SecuritiesAllocationInstruction

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description
1.0		Reference	Ref	[1..1]	+	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocação	This block contains the allocation Identification
1.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da alocação Anteriormente atribuído pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID number. Previously provided by BM&FBOVESPA.
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identifica o Participante requisitante da inclusão de alocação.	Identifies the Participant who is requesting the allocation inclusion.
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.

2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negocio.	This block provides details of the trade.
3.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Fornece a data do pregão.	Provides the trade date.
3.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.
3.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.
3.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.
4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).

4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.
4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).
4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.
4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)
5.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	Este bloco contem informações do código de negociação.	This block contains the Ticker Symbol.
5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3
6.0		Allocation	Allcn	[1..*]	+	Este bloco especifica informações da alocação	Allocation information
6.1		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.
6.2		OriginAccount	OrgnAcct	[1..1]	+	Este bloco identifica a conta em que o negócio está atualmente alocado.	This block identifies the account in which trade is allocated.
6.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number
6.3		DestinationAccount	DstnAcct	[1..1]	+	Identificação da conta que irá receber a quantidade alocada por essa mensagem.	Account identification that will receive the amount allocated for this message.

6.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number
6.4		Quantity	Qty	[1..1]	+	Especifica a quantidade destinada à alocação.	Specifies the trade quantity to be allocated.
6.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantidade expressa em um valor numérico.	Quantity expressed as a number.
6.5		CustodianIdentification AndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+	Este bloco contém o código de identificação do Agente de Custódia e o código da conta de custódia.	This block identifies the custodian ID and the custodian account ID
6.5.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Fornece detalhes de identificação do participante.	Provides details about the party identification.
6.5.1.1		ProprietaryIdentificatio n	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.
6.5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 1-123456, onde 1 significa CST (Agente de Custódia).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 1-123456, where 1 means CST (Custodian).
6.5.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40
6.5.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.

6.5.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Este bloco contém o código de conta no Agente de Custódia	This block contain the custodian account identification
6.5.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.
6.5.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Código de conta no Agente de Custódia Ex: 115 = Número da Conta	Custodian account ID E.g 115 = Account Number
6.6		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identificação da carteira na depositária..	Identification of the sub account.
6.7		OffHoursInformation	OffHrsInf	[0..1]	+	Este bloco indica se houve quebra de regra no caso de uma solicitação de alocação ou repasse enviado após o horário limite.	Indicates an allocation or give-up being requested after the allocation time limits
6.7.1		OffHoursDelayResponsibility	OffHrsDelyRspnsblty	[0..1]	ExternalOffHoursDelayResponsibilityCode	Para o caso de indicação de repasse, informa o participante responsável pelo repasse realizado fora do prazo limite (quebra de regra), Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	In case of give-up, this field informs the participant responsible for the delay (off-hour request). This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursDelayResponsabilityCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls
6.7.2		OffHoursIndicator	OffHrsInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indica se é uma alocação sendo solicitada fora do prazo limite (quebra de regra).	Indicates if it is an off-hour allocation request
6.7.3		OffHoursReason	OffHrsRsn	[1..1]	ExternalOffHoursReasonCode	Apresenta a justificativa para a alocação ou repasse realizado fora do horário (quebra de regra) Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalOffHoursReasonCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	Specifies the reason for requesting a give-up or allocation after the time limits. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external ExternalOffHoursReasonCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls

BVBG.038.02 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice

Funcionalidade

Escopo

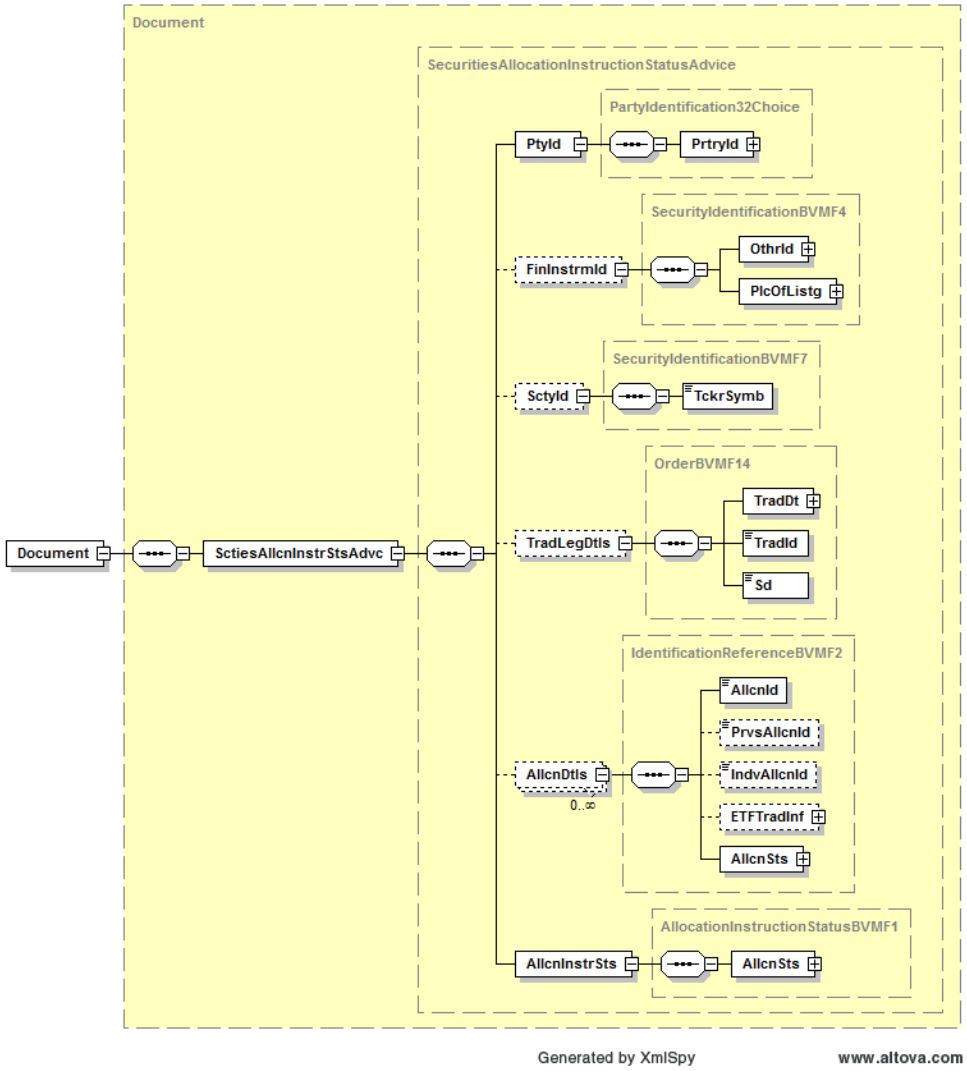
O arquivo BVBG.038.02 “SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice” é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação como retorno dos arquivos BVBG.037.01 “SecuritiesAllocationInstruction”, BVBG.039.01 “SecuritiesAllocationInstructionCancellation” e BVBG.040.02 “TradeManagementReportRequest” (este último, apenas no caso de erro técnico ou erro na validação de negócio).

Uso

O arquivo é utilizado para contingência no caso de indisponibilidade do processo de mensageria.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice” (BVBG.038.02) é composto por mensagens “SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice” (bvmf.014.01), “Erro técnico” (tsmt.016.001.03) e “Erro de negócio” (admi.002.001.01). A estrutura das mensagens de erro podem ser consultadas no documento “Manual Técnico”.


Document
SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice
PartyIdentification32Choice
PtyId
PrtryId
SecurityIdentificationBVMF4
FinInstrmId
OthrId
PlcOfListg
SecurityIdentificationBVMF7
SctyId
TckrSymb
OrderBVMF14
TradLegDtls
TradDt
TradId
Sd
IdentificationReferenceBVMF2
AllcnDtls
0..∞
AllcnId
PrvsAllcnId
IndvAllcnId
ETFTradInf
AllcnSts
AllocationInstructionStatusBVMF1
AllcnInstrSts
AllcnSts
Document
SctiesAllcnInstrStsAdvc
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1. Para cada arquivo BVBG.037.01 ou BVBG.039.01 enviado, a BM&FBOVESPA enviará um arquivo de resposta (BVBG.038.02), apresentando a primeira situação das solicitações enviadas. Para maiores detalhamentos, ver exemplos nas regras dos arquivos BVBG.037.01 e BVBG.039.01.

R2. O Participante deverá informar à BM&FBOVESPA a necessidade de uso do canal de contingência. Ou seja, não poderá ser enviado pelo participante, concomitantemente, arquivos de contingência e mensagens.

Estrutura da mensagem" SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice" (bvmf.014.01)

O header do arquivo está no Manual Técnico.

bvmf.014.01 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice

R1. Os campos deste bloco somente serão preenchidos para informar atualização de preço/ajuste em negócios de ETF Primário.

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block identifies the participant who will receive the "Status Advice" message.	Este bloco identifica o participante que receberá a mensagem "Status Advice".	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[0..1]	+	Provides details about the security identification	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	

2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.0		SecurityIdentification	SctyId	[0..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contem informações do Ticker Symbol.	
3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	

4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[0..1]	+	This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
5.0		AllocationDetails	AllcnDtls	[0..*]	+	This block contains references to the control numbers assigned by the participant for each allocation requested in the message and the numbers attributed to each allocation by BM&FBOVESPA.	Este bloco contém as referências dos números de controle atribuídos pelo participante para cada alocação solicitada e os números de cada alocação atribuídos pela BM&FBOVESPA.	
5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Allocation ID number. Provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação. Atribuído pela BM&FBOVESPA.	
5.2		PreviousAllocationIdentification	PrvsAllcnId	[0..1]	Max35Text	Identifies the previous AllocationID known by the BM&FBOVESPA .	Identifica o número de controle da alocação anterior, fornecido pela BM&FBOVESPA .	
5.3		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[0..1]	Max35Text	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and this allocation status response.	Número individual de alocação. Esse número foi atribuído pelo sistema do participante que enviou a mensagem de requisição, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e esta mensagem de situação de alocação	
5.4		ETFTradeInformation	ETFTradInf	[0..1]	+	Inform the negotiation ETF trade.	Informa os dados de negociação do trade de ETF.	R1
5.4.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	A Unique identification for this ETF operation	Identificador unico da operação do ETF na	

						in the depository	depositária.	
5.4.2		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode at ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	
5.4.3		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	The adjustment is the diference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
5.4.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Specifies the price.	Este bloco informa o valor negociado.	
5.4.4.1		Value	Val	[1..1]	+	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
5.4.4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
5.4.5		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveCurrencyAndAmount	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
5.5		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	This structure provides the status and/or the error of each processing allocations or final give-up status.	Essa estrutura identifica a situação e/ou o erro de cada processamento das alocações e situação final de repasse.	

5.5.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
5.5.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.5.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
5.5.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
6.0		AllocationInstructionStatus	AllcnInstrSts	[1..1]	+	This block contains the allocation status of the request and/or the error found in the request.	Este bloco contém a situação da solicitação de alocação e/ou o erro encontrado para a solicitação.	
6.1		AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+	This block identifies the allocation status request.	Este bloco identifica a situação da solicitação de alocação.	
6.1.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	

6.1.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalAllocationInstructionStatus in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalAllocationInstructionStatus localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
6.1.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
6.1.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	

BVBG.039.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation

Funcionalidade

Escopo

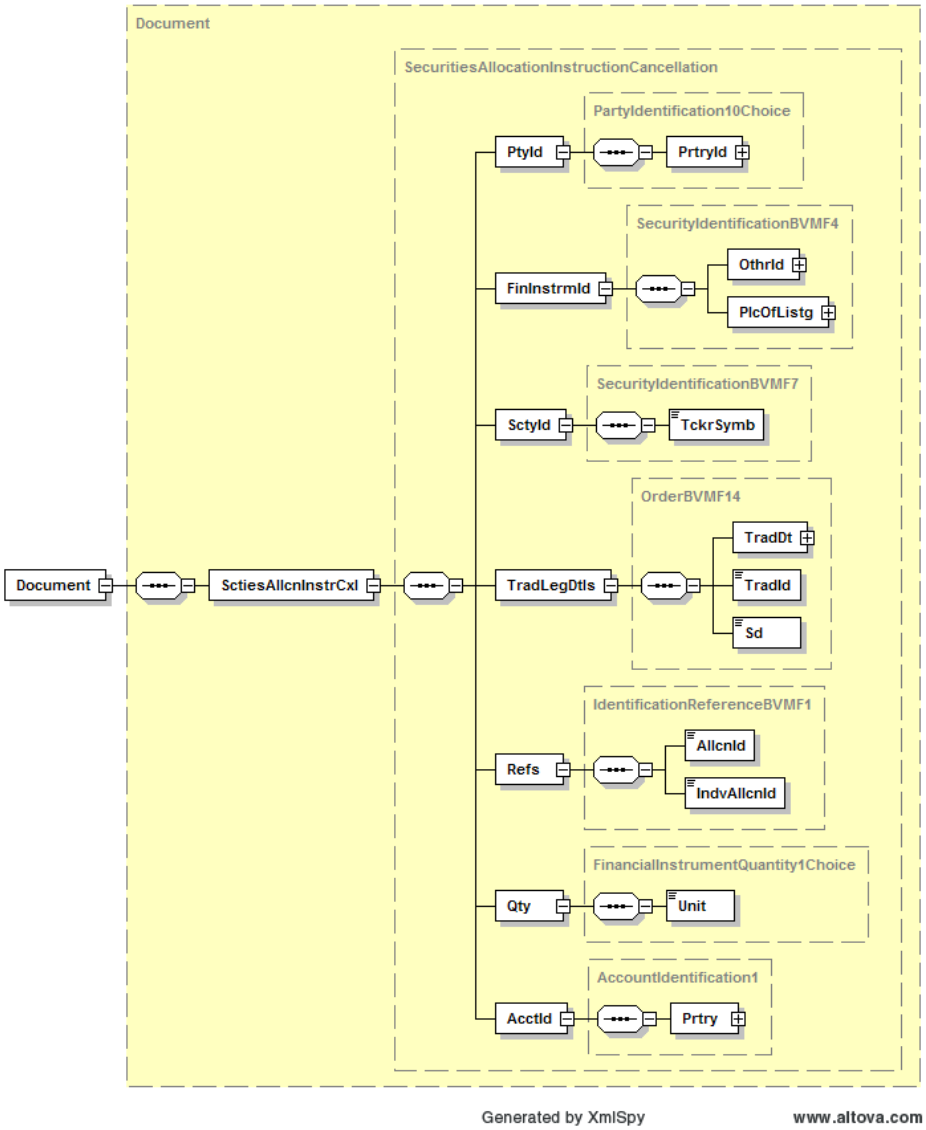
O arquivo "SecuritiesAllocationInstructionCancellation" é enviado pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA, para solicitar a exclusão de alocação de negócios.

Uso

O arquivo é utilizado para contingência no caso de indisponibilidade do processo de mensageria.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “SecuritiesAllocationInstructionCancellation” (BVBG.039.01) é composto por mensagens “SecuritiesAllocationInstructionCancellation” (bvmf.015.01).


Document
SecuritiesAllocationInstructionCancellation
PartyIdentification10Choice
PtyId
PrtryId
SecurityIdentificationBVMF4
FinInstrmId
OthrId
PlcOfListg
SecurityIdentificationBVMF7
SctyId
TckrSymb
OrderBVMF14
TradDt
TradId
Sd
Document
SctiesAllcnInstrCxl
TradLegDtls
IdentificationReferenceBVMF1
Refs
AllcnId
IndvAllcnId
FinancialInstrumentQuantity1Choice
Qty
Unit
AccountIdentification1
AcctId
Prtry
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1. Para cada arquivo BVBG.039.01 enviado, a BM&FBOVESPA enviará um arquivo de resposta (BVBG.038.02), apresentando o a primeira situação das solicitações enviadas. Exemplo:

- Supondo o envio do arquivo BVBG.039.01, contendo várias solicitações de exclusão de alocação.
- O arquivo BVBG.038.02 retornará a primeira situação de cada solicitação enviada no arquivo BVBG.039.01. Por exemplo, no caso de exclusão de alocação não aprovada automaticamente pela área de risco, a situação inicial desta solicitação informada ao Participante será "pendente de análise de risco". Não será enviado novo arquivo BVBG.038.02 caso haja alteração na situação da operação (por exemplo, rejeitado pela análise do risco). Para acompanhamento das situações, o participante poderá realizar consulta nas telas do sistema ou por meio de solicitação de arquivos de consulta (BVBG.040.02).

R2. O Participante deverá informar à BM&FBOVESPA a necessidade de uso do canal de contingência. Ou seja, não poderá ser enviado pelo participante, concomitantemente, arquivos de contingência e mensagens.

Estrutura da mensagem" SecuritiesAllocationInstructionCancellation" (bvmf.015.01)

O header do arquivo está no Manual Técnico.

bvmf.015.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Descrição	Description	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Participante que solicita o cancelamento da alocação.	Participant who is submitting the allocation exclusion.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	

1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	
2.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	Provides details about the security identification.	
2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	
2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Tipo da identificação.	Identification type.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	
2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Mercado em que o instrumento está listado.	Market on which the security is listed.	

2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	
3.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	Este bloco contem informações do código de negociação.	This block contains the Ticker Symbol.	
3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	
4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+	Este bloco fornece detalhes do negócio.	This block provides details of the trade.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Fornece a data do pregão.	Provides the trade date.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Especifica uma data.	Specified date.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Número do negócio.	Trade identification.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	
5.0		References	Refs	[1..1]	+	Este bloco identifica o número de alocação atribuído pela BM&FBOVESPA e número de alocação individual atribuído pelo participante.	This block identifies the allocation identification assigned by the BM&FBOVESPA and the individual allocation identification assigned by the participant.	
5.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Número de controle da alocação. Provido pela BM&FBOVESPA.	Allocation ID. Provided by BM&FBOVESPA.	
5.2		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	
6.0		Quantity	Qty	[1..1]	+	Especifica a quantidade a ser excluída da alocação.	Quantity to be excluded.	
6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantidade expressa como um valor numérico.	Quantity expressed as a number.	
7.0		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Identificação da conta a ser excluída da alocação.	Account ID to be excluded.	

7.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	
7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	

BVBG.040.02 – TradeManagementReportRequest

Funcionalidade

Escopo

O arquivo "TradeManagementReportRequest" é enviado pelo Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA e permite requisitar consulta de operações, conforme tipos abaixo:

- Negócios Realizados (TradeLegNotification)
- Negócios Alocados* (SecuritiesAllocationDetails)
- Repasses Enviados – Origem (GiveUpTradeDetails)
- Repasses Recebidos– Destino (TakeUpTradeDetails)

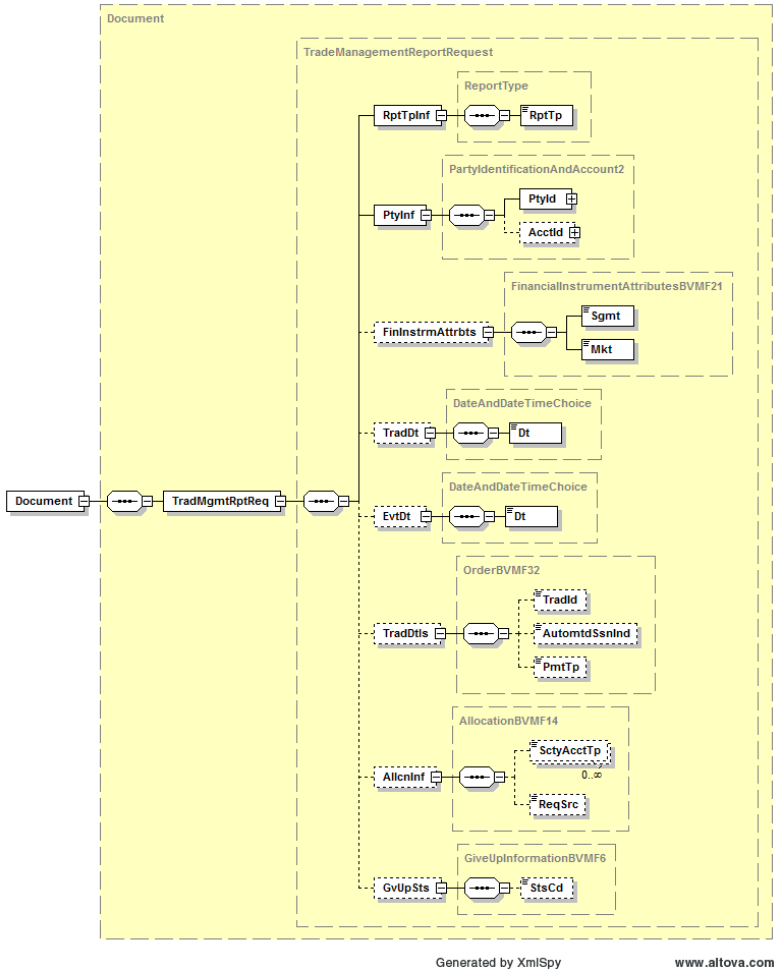
* Disponível também para Agentes de Custódia. Apresenta apenas os negócios direcionados ao custodiante.

Uso

Esta mensagem é enviada pelo Participante à BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar uma consulta de operações. O arquivo é utilizado para contingência no caso de indisponibilidade do processo de mensageria.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “TradeManagementReportRequest” (BVBG.040.02) é composto pela mensagem “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02).



Regras

R1. Caso o campo data do evento não seja preenchido, serão retornados apenas eventos ocorridos na data corrente.

R2. O campo data do evento (Event Date) apresenta as seguintes características, dependendo do arquivo a ser solicitado:
Se arquivo = TradeLegNotification, Data Evento = Data da negociação e Período disponível para consulta = D-1 a D
Se arquivo = SecuritiesAllocationDetails, Data Evento = Data do pregão e Período disponível para consulta = D-1 a D+1
Se arquivo = GiveUpTradeDetails, Data Evento = Data do evento de repasse - origem e
Período disponível para consulta = Mercados Derivativos e Derivativos sobre Ações: D
Mercado a vista de ações: D-1 a D
Se arquivo = TakeUpTradeDetails, Data Evento = Data do evento de repasse - destino e
Período disponível para consulta = Mercados Derivativos e Derivativos sobre Ações: D
Mercado a vista de ações: D-1 a D
Onde: D= Data do pregão corrente
R3. Poderá ser selecionado apenas um único tipo de arquivo por mensagem de requisição.
R4. Filtro disponível somente se o Tipo de Relatório informado for " 4 - Allocation Details".
R5. Filtro disponível somente para os Tipos de Relatórios:
" 1 - GiveUpTradeDetails" ou " 2 - TakeUpTradeDetails".
R6. Permitido somente para os Tipos de Relatórios:
" 1 - GiveUpTradeDetails" ou " 2 - TakeUpTradeDetails".

R7. Este arquivo poderá conter somente uma mensagem “TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02)

Estrutura da mensagem” TradeManagementReportRequest” (bvmf.018.02)

O header do arquivo está no Manual Técnico.

bvmf.018.02 – TradeManagementReportRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportTypeInformation	RptTpInf	[1..1]	+	Type of requested report.	Tipo do relatório solicitado.	

1.1		ReportType	RptTp	[1..1]	ExternalReportTypeCode	Type of requested report. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalReportTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de relatório solicitado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalReportTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains information about the party identification and account identification as request parameter.	Este bloco contém informações sobre a identificação do participante e da conta como parâmentro da solicitação.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttr bts	[0..1]	+	This block contains request´s parameters of elements characterising a financial instrument.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

3.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

3.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

4.0		TradeDate	TradDt	[0..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	R6
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		EventDate	EvtDt	[0..1]	+	Indicates the date as follows: - Give up request: give up event date - Take up request : take up event date - Allocation details: trade date - Captured trades request: capture trade date. If left empty, report will return current day events.	Informa a data, de acordo com o cenário abaixo: - Give up Trade Details : refere-se à data do evento de envio do repasse (Origem); - Take up Trade Details : refere-se à data do evento de recebimento de repasse (Destino); - Allocation Details: refere-se à data do pregão; - Captured Trade Details :refere-se à data da captura do negócio. Se este campo for deixado em branco, retornará os eventos referentes à data de pregão corrente.	
5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
6.0		TradeDetails	TradDtls	[0..1]	+	This block contains information related to trade.	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio.	

6.1		TradeIdentification	TradId	[0..1]	Max35Text	Reference assigned to the trade.	Número do negócio.	
6.2		AutomatedSessionIndicator	AutomtdSsnInd	[0..1]	YesNoIndicator	Indicates if the trade is from Automated Session or Non Automated Session.	Indica se o trade é originado de uma sessão automática ou de uma sessão não automatizada.	
6.3		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	This field identifies the settlement type . This filed requires an external codlelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts	
7.0		AllocationInformation	AllcnInf	[0..1]	+	This block contains information about allocation.	Este bloco contém informações sobre alocação.	
7.1		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[0..*]	ExternalSecurityAccountTypeCode	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo	R4

							ExternalCodeLists_BVMF.xls	
7.2		RequestSource	ReqSrc	[0..1]	ExternalRequestSourceCode	Indicates the allocation source. Only applicable for intraday requests. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalRequestSourceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Código identificador da origem da solicitação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRequestSourceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
8.0		GiveUpStatus	GvUpSts	[0..1]	+	This block contains information on the situation of GiveUp.	Este bloco contém informações sobre a situação do repasse.	R5
8.1		StatusCode	StsCd	[0..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Informa o Status do Give Up. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

bvmf.186.01 – AllocationHashRequest

Funcionalidade

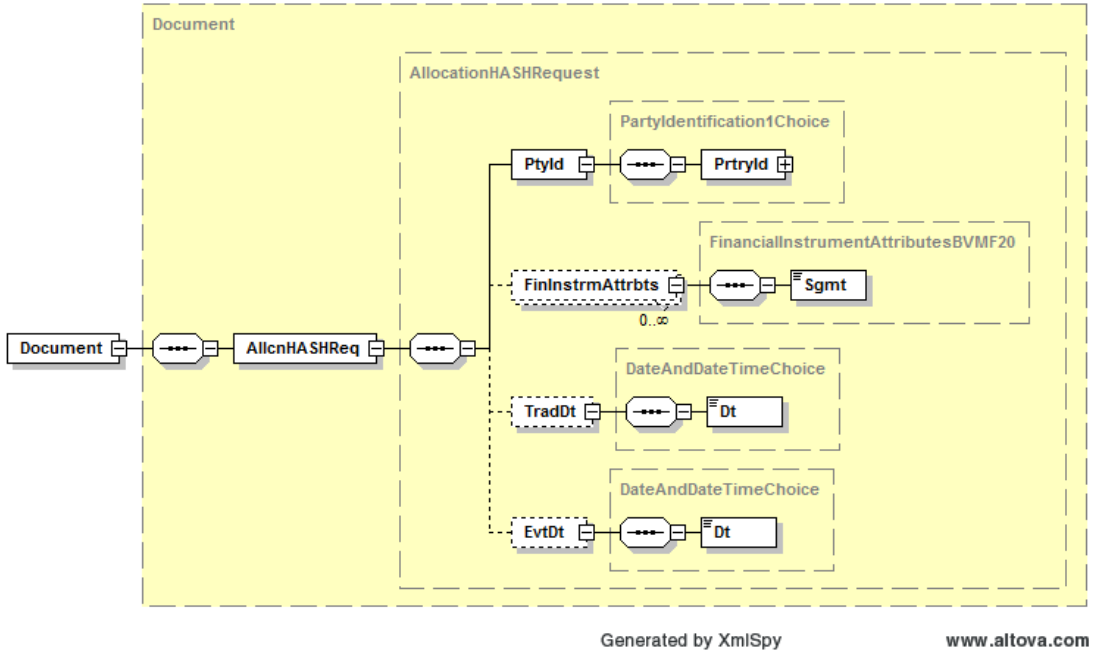
Escopo

A mensagem "AllocationHashRequest" é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação para a BM&FBOVESPA com o objetivo de requisitar o arquivo contendo o hash das alocações do participante.

Uso

Esta mensagem é enviada pelo Participante à BM&FBOVESPA com o objetivo de realizar a conciliação da alocação.

Diagrama da Mensagem



Regras

Estrutura da mensagem" AllocationHashRequest" (bvmf.186.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block contains the participant identification.	Este bloco contém a identificação do participante.	

1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[0..*]	+	This block contains request´s parameters of elements characterising a financial instrument.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
3.0		TradeDate	TradDt	[0..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.0		EventDate	EvtDt	[0..1]	+	Refers to the allocation event date.	Refere-se à data do evento da alocação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	

BVBG.081.01 – AllocationHashResponse

Funcionalidade

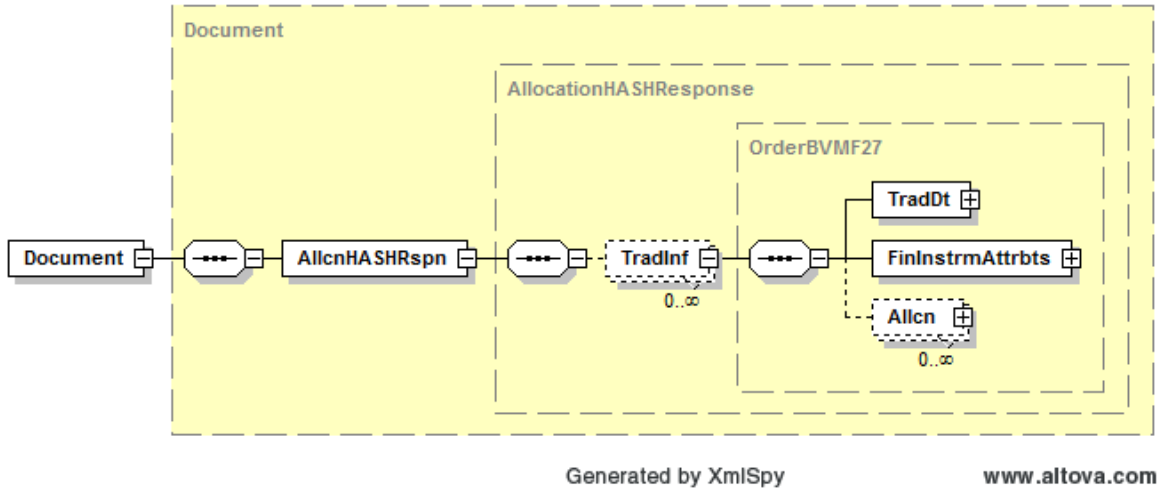
Escopo

O arquivo “AllocationHashResponse” é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com o objetivo de informar o arquivo contendo o hash das alocações do participante.

Uso

Este arquivo é enviado pela BM&FBOVESPA para o Participante com o objetivo de realizar a conciliação da alocação.

Diagrama da Mensagem



Regras

Estrutura da mensagem" AllocationHashResponse" (bvmf.187.01)

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		TradeInformation	TradInf	[0..*]	+	Provides trade information.	Informação sobre a negociação.	
1.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date and time.	Fornece a data e hora do pregão.	
1.1.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	

1.2		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	This block contains request´s parameters of elements characterising a financial instrument.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
1.2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
1.2.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
1.3		Allocation	Allcn	[0..*]	+	Provides allocation information.	Fornece informações de alocação.	
1.3.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
1.3.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors.	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						e.g 115 = Account Number	115 = Número da Conta	
1.3.2		HASHCode64	HASHCd64	[1..1]	RestrictedHASH64 Text	Sequence concatenated specific informations each allocation and that will be used to a realization of conciliation between BM&FBovespa and participant.	Sequência concatenada de informações específicas daalocação e que será utilizada para realização de conciliação entre a BM&FBovespa e o participante.	